

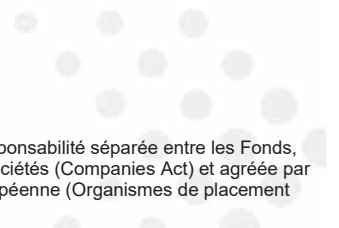


PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

Rapport annuel

31 décembre 2023



CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES

Type de Fonds :

OPCVM

Nombre de Fonds proposés par la Société :

56 Fonds

Catégories d'actions proposées par la Société au 31 décembre 2023* :

Institutions
 Institutions en AUD (couverte)
 Institutions en BRL (couverte)
 Institutions en CAD (couverte)
 Institutions en CHF (couverte)
 Institutions en CHF (partiellement couverte)
 Institutions en CZK (couverte)
 Institutions en EUR (exposition au risque de change)
 Institutions en EUR (couverte)
 Institutions en EUR (partiellement couverte)
 Institutions en EUR (non couverte)
 Institutions en GBP (exposition au risque de change)
 Institutions en GBP (couverte)
 Institutions en GBP (partiellement couverte)
 Institutions en GBP (non couverte)
 Institutions en HKD (non couverte)
 Institutions en ILS (couverte)
 Institutions en JPY (couverte)
 Institutions en MXN (couverte)
 Institutions en NOK (couverte)
 Institutions en NOK (partiellement couverte)
 Institutions en NZD (couverte)
 Institutions en RMB (couverte)
 Institutions en RMB (non couverte)
 Institutions en SEK (couverte)
 Institutions en SGD (couverte)
 Institutions en USD (exposition au risque de change)
 Institutions en USD (couverte)
 Investisseurs
 Investisseurs en AUD (couverte)
 Investisseurs en CAD (couverte)
 Investisseurs en CHF (couverte)
 Investisseurs en EUR (couverte)
 Investisseurs en EUR (non couverte)
 Investisseurs en GBP (couverte)
 Investisseurs en HKD (non couverte)
 Investisseurs en JPY (couverte)
 Investisseurs en NOK (couverte)
 Investisseurs en RMB (couverte)
 Investisseurs en SEK (couverte)
 Investisseurs en SGD (couverte)
 Investisseurs en USD (couverte)
 Investisseurs en USD (non couverte)
 Administrations
 Administrations en AUD (couverte)
 Administrations en CHF (couverte)
 Administrations en EUR (couverte)
 Administrations en GBP (couverte)
 Administrations en HKD (non couverte)
 Administrations en JPY (couverte)
 Administrations en SEK (couverte)
 Administrations en SGD (couverte)
 BE Détail
 BM Détail
 BM Détail en AUD (couverte)
 BM Détail Décumulation

BM Détail en USD (couverte)
 BN Détail
 Catégorie E
 Catégorie E en AUD (couverte)
 Catégorie E en AUD (partiellement couverte)
 Catégorie E en CHF (couverte)
 Catégorie E en EUR (exposition au risque de change)
 Catégorie E en EUR (couverte)
 Catégorie E en EUR (partiellement couverte)
 Catégorie E en EUR (non couverte)
 Catégorie E en GBP (couverte)
 Catégorie E en GBP (partiellement couverte)
 Catégorie E en HKD (non couverte)
 Catégorie E en JPY (couverte)
 Catégorie E en RMB (couverte)
 Catégorie E en SGD (couverte)
 Catégorie E en SGD (partiellement couverte)
 Catégorie E en USD (exposition au risque de change)
 Catégorie E en USD (couverte)
 G Détail en EUR (couverte)
 H Institutions
 H Institutions en USD (exposition au risque de change)
 H Institutions en USD (couverte)
 M Détail
 M Détail en AUD (couverte)
 M Détail Décumulation
 M Détail en HKD (non couverte)
 M Détail en SGD (couverte)
 M Détail en USD (couverte)
 N Détail
 Catégorie R
 Catégorie R en AUD (couverte)
 Catégorie R en EUR (couverte)
 Catégorie R en GBP (couverte)
 Catégorie T
 Catégorie T en EUR (couverte)
 Catégorie T en USD (couverte)
 Catégorie W
 Catégorie W en CHF (couverte)
 Catégorie W en EUR (couverte)
 Catégorie W en GBP (couverte)
 Catégorie W en NOK (couverte)
 Catégorie W en SGD (couverte)
 Catégorie Z
 Catégorie Z en AUD (couverte)

Types d'actions :

Dans chaque Catégorie, sous réserve du Supplément pertinent, la Société peut émettre des Actions de distribution (actions donnant droit aux bénéfices), des Actions de capitalisation (actions donnant lieu à la capitalisation des bénéfices), des Actions de distribution II (actions cherchant à fournir un rendement amélioré) et des Actions de décumulation (actions qui visent à offrir une distribution excédentaire de revenus).

Actif net (en milliers) :

165 102 555 USD

Participation minimale :

Les Catégories d'actions Institutions, Investisseurs, Administrations, H Institutions et W supposent une participation minimale de 500 000 USD ou l'équivalent dans la devise de la Catégorie d'actions considérée. Les Catégories d'actions BE Détail, BM Détail, BN Détail, E, G Détail, M Détail, N Détail, R et T supposent une participation minimale de 1 000 USD ou l'équivalent dans la devise de la Catégorie d'actions considérée.

* Reportez-vous à la note 19 pour obtenir la liste complète de toutes les catégories d'actions actuellement en circulation au cours de la période de déclaration actuelle et de la période précédente. Reportez-vous au Prospectus pour obtenir la liste de toutes les Catégories d'actions proposées par chaque Fonds.

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES (suite)

Les Catégories Z supposent une participation minimale de 20 millions d'USD ou l'équivalent dans la devise de la Catégorie d'actions considérée. Pacific Investment Management Company LLC (« PIMCO »), en son seul pouvoir d'appréciation, est en droit de déroger aux seuils de souscription initiale minimale et de participation minimale indiqués dans le Prospectus en vigueur.

Jour de négociation :

S'agissant d'un Fonds, le ou les jours indiqués dans le Supplément concerné pour ce Fonds, étant entendu qu'en tout état de cause, il y aura un Jour de négociation par quinzaine. Les Administrateurs ont délégué à PIMCO le pouvoir de modifier la fréquence des Jours de négociation pour chaque Fonds. Toute modification de la fréquence des Jours de négociation doit impérativement recevoir l'approbation préalable du Dépositaire et sera notifiée à l'avance aux actionnaires du ou des Fonds affectés.

Nonobstant ce qui précède, aucun Fonds n'aura de Jour de négociation si, en raison de jours fériés ou de fermetures des marchés/bourses dans toute juridiction, il est difficile (i) d'administrer un Fonds ou (ii) d'évaluer une partie des actifs d'un Fonds. Pour plus d'informations sur les jours de fermeture des Fonds tout au long de l'année, les actionnaires et candidats à l'investissement sont priés de contacter l'Agent administratif ou de se reporter au Calendrier des jours fériés des Fonds (dont un exemplaire peut également être obtenu auprès de l'Agent administratif).

Devise fonctionnelle des Fonds :

USD (\$), sauf pour les Fonds UK Corporate Bond Fund et UK Long Term Corporate Bond Fund, libellés en livre sterling britannique (£), et en ce qui concerne les Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Short-Term Fund, PIMCO European High Yield Bond Fund et PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, libellés en euro (€).

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES (suite)

Autorisation à Hong Kong :

La Société et certains de ses Fonds sont autorisés par la Commission des valeurs mobilières et contrats à terme standardisés de Hong Kong (« SFC » - Securities and Futures Commission) et sont soumis aux exigences du Code relatif aux SICAV et fonds communs de placement (« Code » - Code on Unit Trusts and Mutual Funds) de la SFC. Actuellement, les Fonds suivants peuvent acquérir des instruments financiers dérivés à des fins d'investissement, de couverture et/ou de gestion efficace de portefeuille. Le recours aux instruments financiers dérivés est soumis aux limites maximales prévues en vertu du Code révisé tel que décrit ci-dessous. La classification des Fonds en tant que fonds dérivé ou fonds non dérivé est également présentée ci-dessous. Aucun changement n'est apporté à la façon dont les Fonds suivants ont recours aux instruments financiers dérivés :

| Fonds | Exposition maximale nette prévue aux instruments dérivés (% de la Valeur Nette d'Inventaire) | Classification du Fonds |
|---|--|-------------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | jusqu'à 50 % | Fonds non dérivé |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | jusqu'à 50 % | Fonds non dérivé |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | jusqu'à 50 % | Fonds non dérivé |
| Fonds Commodity Real Return Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Diversified Income Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Global Bond Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | jusqu'à 50 % | Fonds non dérivé |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Global Real Return Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Income Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Income Fund II | jusqu'à 50 % | Fonds non dérivé |
| Fonds Low Average Duration Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds Total Return Bond Fund | plus de 100 % | Fonds dérivé |
| Fonds US High Yield Bond Fund | jusqu'à 50 % | Fonds non dérivé |

Les Fonds suivants ne sont pas autorisés à Hong Kong et ne sont pas ouverts aux résidents de Hong Kong :

Fonds PIMCO Capital Securities Fund
 Fonds PIMCO Climate Bond Fund
 Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund
 Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund
 Fonds Diversified Income ESG Fund
 Fonds Dynamic Bond Fund
 Fonds Dynamic Multi-Asset Fund
 Fonds Emerging Local Bond ESG Fund
 Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund
 Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund
 Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
 Fonds PIMCO ESG Income Fund
 Fonds Euro Bond Fund
 Fonds Euro Credit Fund
 Fonds Euro Income Bond Fund
 Fonds Euro Long Average Duration Fund
 Fonds Euro Short-Term Fund
 Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
 Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund
 Fonds Global Advantage Fund
 Fonds Global Bond ESG Fund
 Fonds Global Bond Ex-US Fund
 Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund
 Fonds Global Low Duration Real Return Fund
 Fonds Inflation Multi-Asset Fund
 Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund
 Fonds Low Duration Income Fund
 Fonds Low Duration Opportunities Fund
 Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund
 Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
 Fonds Mortgage Opportunities Fund
 Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund
 Fonds StocksPLUS™ Fund
 Fonds Strategic Income Fund
 Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

Fonds UK Corporate Bond Fund
 Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund
 Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund
 Fonds US Short-Term Fund

Autorisation à Singapour

Les Fonds suivants ne sont pas reconnus par la Monetary Authority of Singapore (Autorité monétaire de Singapour) en vertu du Chapitre 289 de la Loi de Singapour sur les valeurs mobilières et contrats à terme standardisés intitulée Securities and Futures Act et ne sont donc pas à la disposition du public de détail à Singapour :

Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund
 Fonds Diversified Income ESG Fund
 Fonds Emerging Local Bond ESG Fund
 Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund
 Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
 Fonds Euro Credit Fund
 Fonds Euro Income Bond Fund
 Fonds Euro Long Average Duration Fund
 Fonds Euro Short-Term Fund
 Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
 Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund
 Fonds Global Bond ESG Fund
 Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund
 Fonds Global Low Duration Real Return Fund
 Fonds Low Duration Opportunities Fund
 Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund
 Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
 Fonds Mortgage Opportunities Fund
 Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund
 Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
 Fonds UK Corporate Bond Fund
 Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund
 Fonds US Short-Term Fund

Page Reuters :
 PAFPPPLC

™ Marque ou marque déposée de Pacific Investment Management Company LLC aux États-Unis et/ou dans certains autres pays.

| | Page |
|--|-------|
| Informations sur le marché* | 4 |
| Informations importantes sur les Fonds | 5 |
| Description des indices de référence | 67 |
| Bilan | 72 |
| Compte de résultat | 92 |
| État de l'évolution des actifs nets | 112 |
| Tableau des investissements | 118 |
| Notes relatives aux États financiers | 752 |
| Rapport des Administrateurs | 884 |
| Rapport du Commissaire aux comptes indépendant | 887 |
| Rapport du Dépositaire | 892 |
| Éléments fournis concernant les rémunérations (non audités) | 893 |
| Variations importantes de la composition du portefeuille (non auditées) | 894 |
| Directive sur les droits des actionnaires II (SRD II) (non auditée) | 950 |
| Informations à fournir en vertu du Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et du Règlement sur la taxinomie (non auditées) | 951 |
| Glossaire (non audité) | 1 072 |
| Informations générales (non auditées) | 1 074 |

| FONDS | Synthèse des Fonds* | Tableau des investissements |
|---|------------------------|--------------------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | 6 | 118 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 7 | 127 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 8 | 135 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | 9 | 149 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | 11 | 157 |
| Fonds Commodity Real Return Fund | 12 | 165 |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 13 | 174 |
| Fonds Diversified Income Fund | 14 | 183 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | 16 | 201 |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | 17 | 212 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | 18 | 220 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | 19 | 237 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | 20 | 247 |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | 21 | 266 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 22 | 276 |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | 23 | 294 |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | 24 | 310 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 25 | 320 |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 26 | 334 |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | 27 | 347 |
| Fonds Euro Bond Fund | 28 | 358 |
| Fonds Euro Credit Fund | 29 | 366 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | 30 | 372 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | 31 | 382 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | 32 | 388 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | 33 | 393 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 34 | 400 |
| Fonds Global Advantage Fund | 35 | 406 |
| Fonds Global Bond Fund | 36 | 422 |
| Fonds Global Bond ESG Fund | 38 | 445 |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | 39 | 460 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 40 | 475 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 41 | 485 |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | 43 | 508 |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 44 | 520 |
| Fonds Global Real Return Fund | 45 | 528 |

| FONDS | Synthèse des Fonds* | Tableau des investissements |
|--|---------------------|-----------------------------|
| Fonds Income Fund | 46 | 538 |
| Fonds Income Fund II | 47 | 576 |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | 49 | 583 |
| Fonds Low Average Duration Fund | 50 | 592 |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 51 | 599 |
| Fonds Low Duration Income Fund | 52 | 609 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 53 | 625 |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | 54 | 636 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 55 | 640 |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | 56 | 643 |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | 57 | 652 |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 58 | 660 |
| Fonds Strategic Income Fund | 59 | 666 |
| Fonds Total Return Bond Fund | 60 | 683 |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 61 | 697 |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | 62 | 711 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | 63 | 719 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | 64 | 725 |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | 65 | 734 |
| Fonds US Short-Term Fund | 66 | 745 |

Le présent rapport annuel et les états financiers audités (le « Rapport annuel ») peuvent être traduits dans d'autres langues. Une telle traduction contient uniquement les mêmes informations et a le même sens que le Rapport annuel en anglais. En cas de contradiction entre le Rapport annuel en anglais et le Rapport annuel dans une autre langue, le Rapport annuel en anglais prévaudra, sauf dans la mesure où (et seulement dans cette mesure) il est exigé par la loi de toute juridiction où les actions sont vendues, que lors d'une action basée sur la divulgation d'un Rapport annuel dans une langue autre que l'anglais, la langue du Rapport annuel sur laquelle une telle action est basée prévaudra. Tout conflit concernant les termes du Rapport annuel, quelle que soit la langue du Rapport annuel, sera régi et interprété conformément à la législation irlandaise.

* Le présent document contient les opinions de la Société, lesquelles peuvent changer sans préavis. Ce document a été diffusé à des fins d'information seulement. Les prévisions, estimations et certaines informations contenues dans les présentes se fondent sur des travaux de recherche exclusifs et ne doivent pas être considérées comme valant conseil d'investissement ou recommandation d'un titre, d'une stratégie ou d'un produit d'investissement particulier. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. Les informations contenues dans les présentes ont été obtenues de sources considérées comme fiables, mais non garanties. Aucune partie du présent document ne peut être reproduite, sous quelque forme que ce soit, ni évoquée dans une autre publication sans permission expresse écrite. PIMCO est une marque déposée d'Allianz Asset Management of America LLC, protégée aux États-Unis et dans le monde entier. ©2024, PIMCO.

Informations sur le marché

Cher Actionnaire,

Le présent rapport annuel couvre la période comptable de 12 mois close le 31 décembre 2023 (la « période comptable »). Vous trouverez dans les pages suivantes les renseignements afférents aux résultats d'investissement et une discussion concernant certains facteurs ayant eu un impact sur la performance au cours de la période comptable.

L'économie mondiale a poursuivi sa croissance malgré une inflation élevée persistante, les hausses de taux d'intérêt, le resserrement des conditions de crédit et les préoccupations géopolitiques touchant de nombreux pays. Cette résilience s'est avérée particulièrement frappante aux États-Unis. En revanche, certaines économies européennes ont récemment connu une croissance relativement faible.

Les banques centrales ont ralenti le rythme des hausses de taux d'intérêt

L'inflation a diminué au cours de la période comptable et plusieurs responsables bancaires ont laissé entendre que les banques centrales pourraient ralentir les hausses agressives des taux d'intérêt. De mars 2022 à juillet 2023, la Réserve fédérale américaine (la « Fed ») a relevé le taux des fonds fédéraux de 5,25 points de pourcentage au total. En septembre, novembre et décembre 2023, la Fed n'a pas augmenté ses taux d'intérêt. En décembre 2023, les communications de la Fed ont laissé entendre que le taux directeur pourrait probablement atteindre ou approcher son maximum pour le cycle de resserrement. De juillet 2022 à septembre 2023, la Banque centrale européenne (« BCE ») a relevé le taux au jour le jour de sa facilité de dépôt de 4,50 points de pourcentage au total, puis a maintenu les taux lors de ses réunions d'octobre et de décembre 2023. Entre décembre 2019 et juillet 2023, la Banque d'Angleterre a relevé son taux directeur de 5,15 points de pourcentage au total, avant de maintenir ses taux en septembre, novembre et décembre 2023. La BCE et la Banque d'Angleterre ont toutes deux reconnu la possibilité de baisses des taux en 2024.

Des rendements en demi-teinte sur les marchés financiers

Le rendement du bon du Trésor américain à 10 ans, titre de référence, a progressé au cours de la période comptable. Dans de nombreux autres marchés développés, les rendements des obligations d'État à 10 ans ont fluctué. Dans l'ensemble, le marché obligataire mondial s'est redressé vers la fin de l'année 2023, soutenu par les déclarations politiques des responsables des banques centrales indiquant la fin possible du resserrement monétaire. Au cours de la période comptable, les obligations mondiales moins bien notées ont généralement enregistré une performance supérieure à celle de leurs homologues mieux notées. Les actions mondiales se sont fortement redressées, tandis que les matières premières ont connu une évolution mitigée en raison des incertitudes économiques. Le dollar américain s'est renforcé par rapport au yen japonais, mais a reculé par rapport à l'euro et à la livre sterling.

Nous continuons à travailler avec diligence pour tirer le meilleur parti de marchés mondiaux dynamiques et gérer les actifs que vous nous avez confiés. Nous vous invitons à échanger avec votre conseiller financier au sujet de vos objectifs, ainsi qu'à consulter le site global.pimco.com pour prendre connaissance de nos analyses les plus récentes.

Cordialement,



Craig A. Dawson
Président

Source : Trading Economics

Les déclarations relatives aux tendances des marchés financiers sont fondées sur les conditions actuelles du marché, qui fluctuent. Il n'existe aucune garantie que ces stratégies d'investissement fonctionneront dans toutes les conditions de marché ou qu'elles conviendront à tous les investisseurs, et chaque investisseur doit évaluer sa capacité à investir sur le long terme, en particulier pendant les périodes de baisse du marché. Les perspectives et les stratégies sont susceptibles d'être modifiées sans préavis.

Les performances passées ne garantissent pas les résultats à venir. Sauf indication contraire, les rendements des indices reflètent le réinvestissement des distributions de revenus et les plus-values, le cas échéant, mais ne reflètent pas les frais, commissions de courtiers ou autres dépenses d'investissement. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.

| Rendements totaux de certaines catégories d'actifs pour la période close le 31 décembre 2023 | |
|--|---------|
| Catégorie d'actifs (mesurée par l'indice, devise) | 12 mois |
| U.S. large cap equities (S&P 500 Index USD) | 26,29 % |
| Global equities (MSCI World Index USD) | 23,79 % |
| European equities (MSCI Europe Index EUR) | 15,83 % |
| Emerging market equities (MSCI Emerging Markets Index EUR) | 9,83 % |
| Japanese equities (Nikkei 225 Index JPY) | 30,90 % |
| Emerging market local bonds (JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index USD Unhedged) | 12,70 % |
| Emerging market external debt (JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global USD Hedged) | 10,45 % |
| Below investment grade bonds (ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index USD Hedged) | 13,78 % |
| Global investment grade credit bonds (Bloomberg Global Aggregate Credit Index USD Hedged) | 8,68 % |
| Fixed-rate local currency government debt of investment grade countries (Bloomberg Global Treasury Index USD Hedged) | 6,72 % |

Au 31 décembre 2023. SOURCE : PIMCO. Actions américaines à grande capitalisation représentées par l'indice S&P 500 Index, actions mondiales représentées par l'indice MSCI World Index, actions européennes représentées par l'indice MSCI Europe Index, actions des marchés émergents représentées par l'indice MSCI Emerging Markets Index, actions japonaises représentées par l'indice Nikkei 225 Index, obligations locales des marchés émergents représentées par l'indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, dette extérieure des marchés émergents représentée par l'indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index, obligations de qualité inférieure à « investment grade » représentées par l'indice ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, obligations de crédit mondiales de qualité « investment grade » représentées par l'indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index, dette gouvernementale à taux fixe en devise locale de pays de qualité « investment grade » représentée par l'indice Bloomberg Global Treasury Index.

À des fins d'illustration uniquement. Veuillez noter que les indices susmentionnés ne sont pas utilisés dans la gestion active d'un quelconque fonds. Ils sont fournis à titre informatif et à des fins de contexte de marché uniquement.

Informations importantes sur les Fonds

Le présent document ne peut être utilisé que précédé du ou conjointement au Prospectus actuel de PIMCO Funds: Global Investors Series plc. Les investisseurs sont invités à étudier soigneusement les objectifs, les risques, les commissions et les frais liés aux investissements dans ces Fonds avant tout placement. Ces données, ainsi que d'autres informations sont fournies dans le Prospectus. Veuillez donc lire attentivement le Prospectus avant d'investir ou d'envoyer des fonds.

Nous estimons que les fonds obligataires ont un rôle important à jouer dans un portefeuille d'investissements diversifié. Toutefois, il convient de noter que, dans un environnement où les taux d'intérêt ont tendance à monter, une hausse des taux risque d'amoinir la performance de bon nombre de fonds obligataires, auquel cas les titres à revenu fixe détenus par un Fonds seraient amenés à se déprécier. La volatilité des titres à revenu fixe peut également s'amplifier pendant les périodes de hausse des taux d'intérêt, ce qui risque d'amplifier aussi les pertes d'un Fonds. Les fonds obligataires et les obligations individuelles de plus longue durée (une mesure utilisée pour déterminer la sensibilité du cours d'un titre aux fluctuations des taux d'intérêt) ont tendance à être plus sensibles aux fluctuations des taux d'intérêt, ce qui les rend généralement plus volatils que des titres ou des fonds de plus brève durée. La performance à plus long terme de la plupart des fonds obligataires tire profit des plus-values qui peuvent découler d'une période prolongée de baisse des taux d'intérêt. Lorsque les taux d'intérêt augmentent, aucune plus-value n'est généralement réalisée.

Les Fonds peuvent être exposés à différents risques en plus de ceux décrits ci-dessus, dans le Prospectus des Fonds et dans le chapitre intitulé Risques financiers figurant dans les Notes relatives aux États financiers. Certains de ces risques peuvent notamment consister en ce qui suit : risques liés aux taux réels, aux produits dérivés, aux petites entreprises, aux titres étrangers, aux titres à rendement élevé, aux investissements dans des secteurs spécifiques et à une épidémie/à une pandémie. Les Fonds peuvent recourir à des instruments dérivés à des fins de couverture ou dans le cadre d'une stratégie d'investissement. Le recours à ces instruments peut supposer certains frais et risques, tels que le risque de liquidité, le risque de taux d'intérêt, le risque de marché, le risque de crédit, le risque de gestion et le risque qu'un Fonds ne puisse pas clôturer une position au moment le plus avantageux. Les Fonds qui investissent dans des produits dérivés risquent de perdre plus que le montant principal investi dans ces produits. De même, un investissement dans des titres étrangers suppose un risque lié aux événements politiques et économiques susceptibles de se produire à l'étranger ; ce risque est accru lorsque l'investissement porte sur des marchés émergents. Les obligations à rendement élevé affichent généralement une notation de crédit inférieure à celle d'autres obligations. Or, les obligations les moins bien notées s'accompagnent d'habitude d'un risque supérieur, en termes de principal, à celui inhérent aux obligations mieux notées. Les petites entreprises peuvent se révéler plus volatiles que les grandes entreprises et, de ce fait, induisent davantage de risques. Enfin, le fait de concentrer ses investissements sur des secteurs individuels suppose un risque et une volatilité accrus par rapport à un fonds diversifié.

Certains Fonds peuvent appliquer une stratégie d'investissement environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »), conduisant généralement à sélectionner ou exclure les titres de certains émetteurs pour des raisons autres que la performance financière. Cette stratégie comporte le risque que la performance d'un Fonds diffère de celle de fonds similaires qui n'appliquent pas de stratégie d'investissement ESG. Par exemple, la mise en œuvre de cette stratégie pourrait affecter l'exposition d'un Fonds à certains secteurs ou catégories d'investissements, ce qui pourrait avoir un impact négatif sur la performance du Fonds concerné. Rien ne garantit que les facteurs utilisés par le Conseiller en investissement refléteront les opinions d'un investisseur particulier, et les facteurs utilisés par le Conseiller en investissement peuvent différer des facteurs qu'un investisseur particulier juge pertinents pour l'évaluation des pratiques ESG d'un émetteur. Les évolutions et la réglementation ESG à venir peuvent avoir un impact sur la mise en œuvre par un Fonds de sa stratégie d'investissement. En outre, la diligence raisonnable liée aux facteurs ESG, les exigences accrues de publication d'informations et de l'utilisation de fournisseurs tiers de données ESG peuvent avoir des conséquences financières.

Les classifications des participations du portefeuille du Fonds dans ce rapport sont effectuées conformément aux normes relatives à l'information financière. La classification des participations d'un portefeuille particulier comme indiquée dans le Tableau des investissements et dans d'autres sections de ce rapport peut différer de la classification utilisée pour les calculs de conformité du Fonds, notamment celle utilisée dans le Prospectus, les objectifs d'investissement et les politiques et limites d'investissements réglementaires et autres, qui peut être basée sur différentes classifications géographique, sectorielle ou de catégories d'actifs. Tous les Fonds sont suivis indépendamment à des fins de conformité en ce qui concerne le Prospectus et les exigences réglementaires. Dans le Tableau des investissements, les participations spécifiques au portefeuille peuvent être agrégées lorsque les investissements ont les mêmes attributs (taux de coupon et dates d'échéance).

Les classifications géographiques des titres dans le présent rapport sont effectuées par pays d'établissement d'une participation. Dans certains cas, le pays d'établissement d'un titre peut être différent de son pays d'exposition économique.

Certains titres et instruments dans lesquels un Fonds est susceptible d'investir sont d'une manière ou d'une autre basés sur le LIBOR (London Interbank Offered Rate). Le LIBOR est un taux d'intérêt moyen, déterminé par l'ICE Benchmark Administration, que les banques s'imputent les unes aux autres au titre des prêts à court terme. Dans le contexte de l'abandon progressif de l'utilisation du LIBOR, les Fonds concernés devront recourir à un autre indice de référence (par exemple, le taux de financement au jour le jour garanti (SOFR), destiné à remplacer le LIBOR en dollar américain, mesure le coût des emprunts au jour le jour sur le marché des accords de mise en pension garantis par des titres du Trésor américain). Il peut s'avérer complexe de déterminer l'effet potentiel de la disparition progressive du LIBOR sur un Fonds ou sur certains titres et instruments dans lesquels un Fonds investit ; cet effet peut varier en fonction de différents facteurs. Cette transition peut également entraîner une réduction de la valeur de certains placements détenus par un Fonds ou une réduction de l'efficacité des opérations connexes du Fonds, comme les couvertures. Ces effets produits par la disparition du LIBOR, ainsi que d'autres effets imprévus, pourraient se traduire par des pertes pour un Fonds.

Sur chaque page individuelle de la Synthèse des Fonds du présent rapport annuel, le graphique sur la performance nette mesure la performance, en supposant le réinvestissement de l'ensemble des distributions de dividendes et des plus-values. Les performances ne reflètent pas la déduction des impôts que paierait un actionnaire sur : (i) les distributions des Fonds ; ou (ii) le rachat d'actions des Fonds. Le graphique de la performance nette mesure la performance de chaque Fonds par rapport à celle d'un indice général de marché (indice de référence). La performance passée de chaque Fonds, avant et après impôts, n'est pas nécessairement indicative de la performance future du Fonds. Un investissement dans un Fonds ne constitue pas un dépôt bancaire et n'est ni garanti, ni assuré par un organisme gouvernemental. Du fait que la valeur et les revenus des actions du Fonds peuvent évoluer à la hausse comme à la baisse, il se peut que vous ne récupériez pas le montant initial de votre investissement dans les Fonds.

PIMCO Funds: Global Investors Series plc est distribué par PIMCO Europe Ltd., 11 Baker Street, Londres W1U 3AH, Royaume-Uni ; par PIMCO Europe GmbH, Seidlstrasse 24-24a, 80335 Munich, Allemagne ; par PIMCO Asia Pte Ltd., 8 Marina View #30-01, Asia Square Tower 1, Singapour 018960, par PIMCO Asia Limited, Suite 2201, 22nd Floor, Two International Finance Centre, 8 Finance Street, Central Hong Kong et par PIMCO Australia Pty Ltd., Level 19, 5 Martin Place, Sydney, New South Wales 2000, Australie ; www.pimco.com.

Les termes définis utilisés et non définis autrement dans le présent Rapport annuel revêtent la signification qui leur est donnée dans le Prospectus de la Société.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|----------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 14 février 2019) | 0,45 % | (2,27 %) |
| Institutions, distribution (lancement le 14 février 2019) | 0,42 % | (2,26 %) |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 25 mai 2021) | 0,13 % | (10,42 %) |
| Investisseurs, distribution (lancement le 20 août 2020) | 0,06 % | (6,55 %) |
| Administrations, distribution (lancement le 14 février 2019) | (0,08 %) | (2,75 %) |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 1 ^{er} juillet 2020) | (0,49 %) | (5,74 %) |
| Catégorie E, distribution (lancement le 14 février 2019) | (0,48 %) | (3,14 %) |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 12 mars 2021) | 0,26 % | (8,85 %) |
| H Institutions, distribution (lancement le 12 mars 2021) | 0,18 % | (8,85 %) |
| M Détail, distribution II (lancement le 14 février 2019) | (0,43 %) | (3,14 %) |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 14 février 2019) | 1,20 % | (1,61 %) |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index | 4,76 % | (2,18 %) ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021) | (1,57 %) | (10,04 %) |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2020) | (2,01 %) | (7,40 %) |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en AUD) | 2,47 % | (7,19 %) ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 23 octobre 2020) | (3,73 %) | (8,66 %) |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 23 octobre 2020) | (3,75 %) | (8,66 %) |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 23 octobre 2020) | (4,59 %) | (9,48 %) |
| Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 23 octobre 2020) | (4,61 %) | (9,48 %) |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en CHF) | 0,36 % | (8,54 %) |
| Catégories libellées en CNH | | |
| Investisseurs en RMB (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020) | (2,83 %) | (6,59 %) |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en CNH) | 1,71 % | (6,09 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2020) | (1,79 %) | (7,73 %) |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 septembre 2020) | (1,82 %) | (7,71 %) |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 10 septembre 2020) | (2,21 %) | (8,44 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2020) | (2,60 %) | (8,51 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 septembre 2020) | (2,69 %) | (8,52 %) |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en EUR) | 2,32 % | (8,14 %) ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 29 juillet 2021) | (0,26 %) | (9,69 %) |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 6 mai 2021) | (0,31 %) | (10,22 %) |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en GBP) | 3,77 % | (9,98 %) ² |
| Catégories libellées en HKD | | |
| Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 14 février 2019) | (0,52 %) | (3,23 %) |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 14 février 2019) | (0,47 %) | (3,24 %) |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (non couvert en HKD) | 4,81 % | (2,28 %) |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021) | (1,08 %) | (9,61 %) |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 20 août 2020) | (1,34 %) | (6,94 %) |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 14 février 2019) | (1,94 %) | (3,63 %) |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 14 février 2019) | (2,00 %) | (3,63 %) |
| Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en SGD) | 3,05 % | (2,87 %) ² |

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund vise à optimiser sa performance absolue tout en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant dans une combinaison d'instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) d'émetteurs économiquement liés aux pays d'Asie hors Japon et dans des produits dérivés associés à ces titres. Les Titres à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) achetés par le Fonds seront notés au moins C par Moody's ou l'équivalent par S&P ou l'équivalent par Fitch (ou s'ils ne sont pas notés, considérés par le Conseiller en investissement comme étant de qualité comparable) à l'exception des titres adossés à des créances hypothécaires pour lesquels il n'existe pas d'exigence de notation de crédit minimum.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sélection des crédits au sein de la poche tactique du crédit d'entreprises de pays non émergents a contribué à la performance relative.
- » La surpondération de certains titres de crédit d'entreprises industrielles coréennes a contribué à la performance relative.
- » La sous-pondération de l'immobilier à Hong Kong a contribué à la performance relative.
- » La sélection des crédits au sein du secteur immobilier chinois a nui à la performance relative.
- » La sélection au sein du crédit quasi souverain des marchés émergents en Asie a nui à la performance relative.
- » La sous-pondération du crédit souverain du Sri Lanka a nui à la performance relative.

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 2 mai 2023) | — | 2,60 % |
| Institutions, distribution (lancement le 4 septembre 2020) | 4,55 % | (2,51 %) |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 2 mai 2023) | — | 2,40 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 27 juillet 2023) | — | 3,70 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 4 septembre 2020) | 3,60 % | (3,35 %) |
| Catégorie E, distribution (lancement le 1 ^{er} juin 2010) | 3,62 % | 2,39 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1 ^{er} décembre 2020) | 5,11 % | (2,50 %) |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index ³ | 7,02 % | 3,29 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2023) | — | 1,30 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 5 mars 2021) | 2,40 % | (5,15 %) |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2023) | — | 1,10 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2023) | — | 2,89 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 mars 2021) | 1,45 % | (5,95 %) |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en EUR) ³ | 4,67 % | (4,09 %) ² |
| Catégories libellées en EUR (non couvertes) | | |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2011) | 0,14 % | 2,82 % |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (non couvert en EUR) ³ | 3,40 % | 4,18 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 13 août 2021) | 3,77 % | (5,03 %) |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en GBP) ³ | 6,11 % | (3,78 %) |
| Catégories libellées en HKD | | |
| Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 4 septembre 2020) | 3,71 % | (3,11 %) |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} mars 2011) | 3,71 % | 1,07 % |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (non couvert en HKD) ³ | 7,23 % | 2,24 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020) | 3,05 % | (2,77 %) |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020) | 2,17 % | (3,60 %) |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en SGD) ³ | 5,41 % | (2,33 %) |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 31 mai 2016 : [90 % de l'Indice JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % de l'Indice LIBOR USD à un mois] * [Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)]/[Indice LIBOR USD à 3 mois] ; à partir du 1^{er} juin 2016 : Indice JPMorgan Asia Credit Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund vise à générer un revenu attrayant et stable. L'appréciation du capital à long terme est un objectif secondaire. Le Fonds peut investir jusqu'à 50 % de son actif total dans des Titres à revenu fixe à haut rendement (tels que définis dans le Prospectus). Le Fonds concentrera ses investissements en investissant au moins deux tiers de son actif total dans des Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) en Asie hors Japon, mais pourra investir jusqu'à un tiers de son actif total dans d'autres Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) y compris ceux d'émetteurs gouvernementaux et privés en dehors de la région Asie hors Japon.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition au crédit d'entreprises hors Chine/Hong Kong a contribué à la performance absolue.
- » L'exposition au crédit souverain des marchés émergents en Asie a contribué à la performance absolue.
- » L'exposition au crédit quasi souverain des marchés émergents en Asie a contribué à la performance absolue.
- » L'exposition au crédit d'entreprises à rendement élevé de Chine et de Hong Kong a nui à la performance absolue, notamment en raison du secteur immobilier chinois.
- » Il n'y a pas eu d'autres facteurs négatifs importants pour ce Fonds.

Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 15 avril 2009) | 11,40 % | 5,50 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 24 septembre 2010) | 11,00 % | 3,72 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 22 juin 2009) | 10,06 % | 4,02 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 janvier 2011) | 10,08 % | 2,63 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2022) | 11,24 % | 2,90 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 29 avril 2022) | 11,16 % | 2,86 % |
| M Détail, capitalisation (lancement le 30 novembre 2023) | — | 4,10 % |
| M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2023) | — | 4,07 % |
| M Détail, distribution II (lancement le 30 novembre 2023) | — | 4,10 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 6 juillet 2016) | 12,43 % | 6,96 % |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index ³ | 16,36 % | 7,86 % ² |
| Catégories libellées en CNH | | |
| Institutions en RMB (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2023) | — | 3,47 % |
| Institutions en RMB (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2023) | — | 3,46 % |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en RMB) ³ | — | 3,76 % |
| Catégories libellées en CNH (non couvertes) | | |
| Institutions en RMB (non couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2023) | — | 3,83 % |
| Institutions en RMB (non couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2023) | — | 3,82 % |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index ³ | — | 4,11 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 avril 2009) | 9,02 % | 4,54 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 22 juin 2009) | 7,67 % | 3,06 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 24 juin 2011) | 7,77 % | 1,54 % |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR) ³ | 13,65 % | 6,69 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 7 avril 2010) | 10,61 % | 3,89 % |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP) ³ | 15,15 % | 6,14 % |
| Catégories libellées en HKD | | |
| M Détail en HKD (non couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2023) | — | 4,00 % |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2023) | — | 4,07 % |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 30 novembre 2023) | — | 4,00 % |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index ³ | — | 4,39 % |
| Catégories libellées en SGD | | |
| M Détail en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2023) | — | 3,70 % |
| M Détail en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2023) | — | 3,67 % |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 30 novembre 2023) | — | 3,70 % |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD) ³ | — | 3,82 % |

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (anciennement PIMCO Global Core Asset Allocation Fund) vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds s'exposera à une grande variété de catégories d'actifs, y compris (sans s'y limiter) des actions, des titres à revenu fixe, des matières premières et des actifs immobiliers (tel que décrit dans le Supplément du Fonds). Le Fonds peut aussi investir dans d'autres Fonds PIMCO Funds et d'autres organismes de placement collectif (conformément au Prospectus).

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition longue aux actions américaines a contribué à la performance, car elles ont dégagé des rendements positifs au cours de la période.
- » L'exposition longue aux actions japonaises a contribué à la performance, car elles ont dégagé des rendements positifs au cours de la période.
- » L'exposition longue aux actions taiwanaises a contribué à la performance, car elles ont dégagé des rendements positifs au cours de la période.
- » L'exposition longue aux actions chinoises a nuï à la performance, car elles ont dégagé des rendements négatifs au cours de la période.
- » L'exposition longue aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux (« MBS ») a nuï à la performance, car l'exposition du Fonds a été élevée pendant les périodes où les écarts se sont élargis davantage que lors de celles où ils se sont resserrés.
- » L'exposition longue au yen japonais (« JPY ») a nuï à la performance, car il s'est déprécié par rapport au dollar américain (« USD ») au cours de la période.

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 29 novembre 2023 : 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index / 40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en USD ; à partir du 30 novembre : 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 juillet 2013) | 9,10 % | 5,13 % |
| Institutions, distribution (lancement le 23 septembre 2014) | 9,08 % | 4,34 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 19 mai 2014) | 8,72 % | 3,91 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 19 mai 2014) | 8,80 % | 3,92 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 9 août 2013) | 8,55 % | 4,54 % |
| Administrations, distribution (lancement le 9 août 2013) | 8,51 % | 4,53 % |
| Administrations, distribution II (lancement le 12 août 2022) | 8,53 % | 4,57 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 octobre 2013) | 8,12 % | 3,91 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 19 mai 2014) | 8,12 % | 3,36 % |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013) | 8,11 % | 3,70 % |
| Catégorie R, distribution (lancement le 18 mars 2014) | 8,91 % | 4,24 % |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014) | 7,68 % | 3,28 % |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 31 octobre 2013) | 9,89 % | 5,63 % |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³ | 5,20 % | 1,46 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018) | 6,87 % | 2,17 % |
| Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 11 août 2015) | 8,23 % | 4,55 % |
| Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index | 3,89 % | 1,62 % ² |
| Catégories libellées en BRL | | |
| Institutions en BRL (couverte), capitalisation (lancement le 2 janvier 2018) | 26,09 % | 0,72 % |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en BRL) ³ | 21,60 % | 0,02 % |
| Catégories libellées en CAD | | |
| Investisseurs en CAD (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018) | 7,99 % | 2,99 % |
| Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) ⁴ | 4,86 % | 1,83 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013) | 4,57 % | 2,79 % |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 juin 2014) | 3,65 % | 0,79 % |
| Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁵ | 1,49 % | (0,57 %) ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013) | 6,84 % | 3,36 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 9 août 2013) | 6,87 % | 3,36 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 29 juillet 2014) | 6,90 % | 2,39 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 26 février 2016) | 6,52 % | 2,97 % |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013) | 6,33 % | 2,84 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 octobre 2013) | 5,94 % | 2,20 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015) | 5,89 % | 1,37 % |
| Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2014) | 6,72 % | 2,14 % |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 5,44 % | 1,27 % |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁶ | 3,29 % | 0,13 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013) | 8,44 % | 4,17 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 juillet 2013) | 8,46 % | 4,24 % |
| Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2020) | 8,09 % | 0,24 % |
| Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2014) | 8,28 % | 2,98 % |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁷ | 4,78 % | 0,98 % ² |

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO Capital Securities Fund vise à fournir une exposition ciblée à des Titres de capital (tels que définis dans le Prospectus) au cours attractif et à la performance totale maximum, conformément à l'objectif de préservation du capital et de gestion prudente des investissements, en investissant dans un portefeuille géré activement d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) et d'autres titres, dont au moins 80 % investis en Titres de capital conformément aux politiques énoncées dans le Supplément du Fonds. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux obligations supplémentaires de niveau 1 (Additional Tier 1), et en particulier à certains émetteurs britanniques, néerlandais, espagnols et français, a contribué à la performance, car les taux d'intérêt ont augmenté et les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition aux titres financiers senior, et en particulier à certains émetteurs suisses, britanniques et italiens, a contribué à la performance en raison de la baisse des rendements et du resserrement des écarts.
- » L'exposition aux obligations de niveau 2 (Tier 2), et en particulier aux émetteurs italiens et allemands, a contribué à la performance grâce à une combinaison de bons résultats, des relèvements de notations et d'une levée de fonds couronnée de succès.
- » L'exposition aux obligations supplémentaires de niveau 1 (Additional Tier 1, AT1) émises par une banque suisse, ces titres ayant été dépréciés suite à l'acquisition par un concurrent local.
- » Il n'y a pas eu d'autres facteurs négatifs importants pour ce Fonds.

Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹ (suite)

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en HKD | | |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017) | 8,23 % | 2,63 % |
| Indice HIBOR Index à 3 mois | 4,85 % | 1,91 % |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021) | 7,53 % | (1,93 %) |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018) | 7,16 % | 2,71 % |
| Administrations en SGD (couverte), distribution II (lancement le 12 août 2022) | 7,00 % | 3,41 % |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 décembre 2013) | 6,64 % | 3,40 % |
| Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA ⁸ | 3,76 % | 1,35 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Capital Securities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 3 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

⁴ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Capital Securities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 3 mois (couvert en CAD) ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA).

⁵ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Capital Securities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR USD à 3 mois (couvert en CHF) ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index.

⁶ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Capital Securities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 3 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

⁷ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Capital Securities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR GBP à 3 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.

⁸ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Capital Securities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR GBP à 3 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 23 septembre 2020) | 8,62 % | (1,30 %) |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 février 2023) | — | 7,20 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 23 septembre 2020) | 9,18 % | (0,77 %) |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD) | 9,55 % | (3,12 %) ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 17 avril 2023) | — | 4,72 % |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en AUD) | — | 5,79 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 13 novembre 2020) | 3,92 % | (4,17 %) |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en CHF) | 4,79 % | (6,13 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020) | 6,32 % | (2,91 %) |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 2 décembre 2020) | 6,40 % | (3,35 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020) | 5,38 % | (3,77 %) |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en EUR) | 7,07 % | (4,83 %) ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020) | 7,68 % | (1,91 %) |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 avril 2021) | 7,80 % | (2,45 %) |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en GBP) | 8,59 % | (3,85 %) ² |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2021) | 6,27 % | (3,89 %) |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021) | 5,73 % | (4,76 %) |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en SEK) | 7,20 % | (5,58 %) ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 26 février 2021) | 6,95 % | (2,19 %) |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en SGD) | 7,83 % | (3,91 %) |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO Climate Bond Fund recherche des rendements ajustés au risque optimaux, en appliquant une gestion prudente des investissements, tout en tenant compte des risques et des opportunités à long terme liés au climat. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit dans des circonstances normales au moins 80 % de son actif total dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Le resserrement des écarts et le portage positif du crédit de qualité « investment grade », en particulier dans les secteurs des services financiers et des services aux collectivités, ont contribué à la performance absolue.
- » Le resserrement des écarts et le portage positif du crédit d'entreprise à rendement élevé ont contribué à la performance absolue.
- » L'exposition longue à la dette des marchés émergents libellée en devises fortes, en particulier dans le secteur des services aux collectivités, a contribué à la performance absolue, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance absolue en raison de la hausse des rendements de l'extrémité à court terme de la courbe.
- » L'exposition longue aux obligations liées au gouvernement a nui à la performance absolue, car les écarts sur ces titres se sont creusés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|-----------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 août 2006) | (7,77 %) | (0,67 %) |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 11 août 2011) | (8,05 %) | (2,14 %) |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 septembre 2007) | (8,55 %) | (1,98 %) |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2022) | (7,92 %) | (13,86 %) |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return | (7,91 %) | (1,92 %) ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 juin 2010) | (9,90 %) | (1,23 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 7 mars 2012) | (10,71 %) | (3,68 %) |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en EUR) | (10,07 %) | (2,35 %) ² |
| Catégories libellées en EUR (non couvertes) | | |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 11 juin 2021) | (10,94 %) | 7,01 % |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (non couvert en EUR) | (11,10 %) | 8,23 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} mars 2017) | (8,43 %) | 2,78 % |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en GBP) | (8,61 %) | 2,13 % |
| Catégories libellées en GBP (non couvertes) | | |
| Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 novembre 2022) | (12,99 %) | (15,43 %) |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (non couvert en GBP) | (13,09 %) | (15,49 %) |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2021) | (9,99 %) | 0,88 % |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en SGD) | (9,40 %) | 3,68 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Commodity Real Return Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant dans des instruments dérivés (lesquels peuvent être cotés en bourse ou hors cote), à savoir des contrats de swap, des contrats à terme standardisés, des options sur contrats à terme standardisés, des billets structurés et des billets liées à des indices de matières premières. Ceci lui permet de s'exposer à tout indice ou sous-indice faisant référence à des matières premières (notamment tout indice appartenant à la famille d'indices Bloomberg Commodity) pour autant que celui-ci soit conforme aux exigences formulées par la Banque centrale d'Irlande et, si nécessaire, ait été validé par cette dernière. Des informations détaillées sur les indices employés par le Fonds, ainsi que sur les types de matières premières auxquels ceux-ci font référence sont disponibles sur demande auprès du Conseiller en investissement. Ces instruments exposent le Fonds aux performances des marchés des matières premières sans qu'il soit nécessaire d'investir directement dans des matières premières « physiques ». Ils sont adossés à un portefeuille d'instruments à revenu fixe mondiaux géré activement (comme défini dans le Prospectus). Le Fonds peut également investir dans des actions ordinaires et privilégiées, ainsi que dans des titres convertibles dont les émetteurs sont actifs dans des secteurs liés aux matières premières.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Les stratégies actives de matières premières, y compris l'exposition aux California Carbon Allowances (CCA) et la sous-pondération du gaz naturel, ont contribué à la performance relative, car les CCA ont surperformé, tandis que le gaz naturel a sous-performé l'Indice Bloomberg Commodity Index général.
- » Les stratégies de duration en Europe, notamment l'exposition aux écarts sur swaps de la zone euro ont contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition au crédit trisé, en particulier aux obligations garanties (CDO), a contribué à la performance relative, car les écarts des CDO se sont resserrés.
- » L'allocation structurelle aux obligations mondiales à court terme indexées sur l'inflation en tant que nantissement garantissant l'exposition aux matières premières du Fonds a nuï à la performance relative, dans la mesure où ces obligations, telles que mesurées par l'Indice Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD), ont sous-performé le taux de garantie des bons du Trésor américain à 3 mois au sein de l'indice des matières premières.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains japonais au cours de la première moitié de la période a nuï à la performance relative, en raison du coût de financement de la position.
- » La surpondération du point mort d'inflation italien a nuï à la performance relative, les points morts italiens ayant chuté.

Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 14 octobre 2011) | 8,77 % | 3,24 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 décembre 2012) | 7,86 % | 1,73 % |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³ | 5,20 % | 1,31 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2012) | 4,49 % | 0,62 % |
| Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁴ | 1,49 % | (0,55 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2011) | 6,54 % | 1,88 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 décembre 2012) | 5,54 % | 0,26 % |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁵ | 3,29 % | 0,21 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 3 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

⁴ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR USD à 3 mois (couvert en CHF) ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index.

⁵ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 3 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund a pour objectif d'optimiser la performance à long terme, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds cherchera à investir au moins 80 % de son actif net dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus).

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Les stratégies macro, et en particulier l'exposition longue au taux de base américain et le positionnement sur la courbe des États-Unis, ont contribué à la performance.
- » L'exposition longue aux secteurs industriels, et en particulier à certains émetteurs des secteurs de l'immobilier et des biens d'équipement, a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue à certains émetteurs du secteur financier a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue aux créances hypothécaires émises par des organismes gouvernementaux et à certains actifs titrisés a pesé sur la performance en raison du creusement des écarts.
- » L'exposition courte aux indices de swaps de défaillance a nui à la performance, car les écarts se sont resserrés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005) | 9,48 % | 5,24 % |
| Institutions, distribution (lancement le 8 septembre 2008) | 9,48 % | 5,27 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 30 avril 2013) | 9,14 % | 2,50 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 30 avril 2013) | 9,03 % | 2,49 % |
| Administrations, distribution (lancement le 21 juillet 2011) | 8,98 % | 3,38 % |
| BM Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023) | — | 0,25 % |
| BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022) | 7,44 % | 0,49 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006) | 8,49 % | 4,25 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006) | 8,49 % | 4,33 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 8 juin 2011) | 9,30 % | 3,70 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 14 mai 2020) | 9,31 % | 0,63 % |
| M Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023) | — | 0,25 % |
| M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010) | 8,53 % | 3,20 % |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013) | 8,46 % | 2,46 % |
| N Détail, distribution II (lancement le 30 octobre 2020) | 8,60 % | (2,13 %) |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014) | 8,05 % | 1,82 % |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014) | 8,10 % | 1,83 % |
| Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 9,63 % | (1,32 %) |
| Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020) | 9,65 % | (1,32 %) |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD) ³ | 10,84 % | 5,13 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| M Détail en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 décembre 2012) | 6,57 % | 2,32 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en AUD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en AUD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en AUD) ³ | 8,72 % | 3,38 % |
| Catégories libellées en CAD | | |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 20 février 2019) | 8,62 % | 1,19 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en CAD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en CAD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en CAD) ³ | 9,87 % | 1,77 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011) | 4,74 % | 1,86 % |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 31 août 2012) | 4,71 % | 1,17 % |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 11 septembre 2019) | 3,84 % | (3,31 %) |
| Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 4,92 % | (3,87 %) |
| Catégorie W en CHF (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 4,88 % | (3,85 %) |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en CHF), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en CHF) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en CHF) ³ | 5,91 % | 2,05 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 février 2007) | 6,99 % | 3,94 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 octobre 2007) | 7,04 % | 3,95 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 juillet 2007) | 6,69 % | 3,72 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 15 février 2013) | 6,62 % | 1,04 % |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 juillet 2007) | 6,50 % | 3,56 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 3 juillet 2007) | 6,12 % | 3,18 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 16 octobre 2009) | 6,07 % | 2,61 % |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 5,65 % | (0,10 %) |

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Diversified Income Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant au moins les deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sélection de titres dans le crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, en particulier la surpondération de certains émetteurs des secteurs de la banque et du leasing d'avions, ces titres ayant surperformé.
- » Le positionnement sur les taux d'intérêt des marchés développés a contribué à la performance, en particulier le positionnement sur la courbe en Europe, car les rendements ont baissé.
- » La sélection de titres au sein du crédit à rendement élevé a nuí à la performance, notamment la surpondération de certains émetteurs des secteurs des télécommunications, des médias et de la technologie, ces titres ayant sous-performé.
- » La sélection de titres au sein des marchés émergents a nuí à la performance, en particulier l'exposition à certains promoteurs immobiliers chinois, ces titres ayant sous-performé.
- » L'exposition tactique au crédit titrisé a nuí à la performance, notamment les titres adossés à des créances hypothécaires émis et non émis par des organismes gouvernementaux, ces titres ayant sous-performé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹ (suite)

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014) | 5,57 % | (0,10 %) |
| Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 7,14 % | (3,06 %) |
| Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 7,19 % | (3,07 %) |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en EUR), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en EUR) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en EUR) ³ | 8,23 % | 3,64 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 16 mai 2006) | 8,58 % | 4,90 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 14 février 2006) | 8,65 % | 4,84 % |
| Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 21 juillet 2011) | 8,13 % | 2,68 % |
| Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 8,86 % | (2,00 %) |
| Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 8,72 % | (2,01 %) |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en GBP), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en GBP) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en GBP) ³ | 9,74 % | 4,59 % ² |
| Catégories libellées en JPY | | |
| Administrations en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021) | 2,72 % | (7,92 %) |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en JPY), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en JPY) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en JPY) ³ | 4,28 % | (5,67 %) |
| Catégories libellées en MXN | | |
| Institutions en MXN (couverte), capitalisation (lancement le 9 décembre 2020) | 16,86 % | 3,23 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en MXN), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en MXN) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en MXN) ³ | 18,07 % | 5,03 % |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 7,05 % | 4,28 % |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2020) | 6,52 % | (4,91 %) |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en SEK), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en SEK) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en SEK) ³ | 8,24 % | 3,97 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 7 novembre 2019) | 7,84 % | (0,52 %) |
| Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} mai 2019) | 7,25 % | 0,04 % |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} octobre 2019) | 6,90 % | (1,41 %) |
| Catégorie W en SGD (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 7,91 % | (1,82 %) |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en SGD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en SGD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en SGD) ³ | 9,04 % | 1,33 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Diversified Income Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 9 novembre 2015 : 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit Component Index (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index ; à partir du 10 novembre 2015, 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD).

Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 mai 2011) | 9,18 % | 3,65 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 février 2014) | 8,85 % | 2,73 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 16 août 2013) | 8,29 % | 2,31 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 31 mai 2011) | 8,15 % | 2,74 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD) ³ | 11,51 % | 3,62 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 août 2011) | 7,00 % | 2,52 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 1 ^{er} octobre 2013) | 6,93 % | 1,57 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 11 août 2011) | 6,02 % | 1,70 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mai 2013) | 6,10 % | 0,41 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en EUR), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en EUR) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en EUR) ³ | 9,12 % | 2,64 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 23 août 2011) | 8,61 % | 3,41 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2013) | 8,59 % | 2,27 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en GBP), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en GBP) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en GBP) ³ | 10,69 % | 3,41 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund est mesurée comme suit : du lancement au 9 novembre 2015 : Bogley 4309 (Combinaison des trois indices suivants à durée constante de 25 ans : 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index ; à partir du 10 novembre 2015, combinaison des trois indices suivants à durée constante de 25 ans : 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index (couvert en USD) ; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD).

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Pour optimiser son rendement actuel, tout en appliquant une gestion prudente des investissements, le Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund investit au moins 80 % de son actif net dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) à taux flottant et à taux variable, d'Instruments à revenu fixe ayant une durée inférieure ou égale à un an et d'Instruments à revenu fixe et à taux fixe.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

» La sélection de titres dans le crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, en particulier la surpondération de certains émetteurs des secteurs de la banque et du leasing d'avions, ces titres ayant surperformé.

» L'exposition tactique aux indices de dérivés de crédit de qualité « investment grade » et des marchés émergents a contribué à la performance, car ces titres ont enregistré une performance supérieure à celle des obligations au comptant.

» La sélection de titres au sein du crédit à rendement élevé a nui à la performance, notamment la surpondération de certains émetteurs des secteurs des télécommunications, des médias et de la technologie, ces titres ayant sous-performé.

» Le positionnement sur les taux d'intérêt des marchés développés a nui à la performance, en particulier le positionnement sur la courbe aux États-Unis, car les rendements ont baissé.

» La sélection de titres au sein des marchés émergents a nui à la performance, en particulier l'exposition à certains promoteurs immobiliers chinois, ces titres ayant sous-performé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 9,91 % | 6,01 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 8,93 % | 5,05 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified | 10,58 % | 6,49 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 7,48 % | 3,40 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 6,58 % | 2,50 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (couvert en EUR), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (couvert en EUR) et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en EUR). | 7,97 % | 3,66 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 8,95 % | 4,91 % |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (couvert en GBP), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (couvert en GBP) et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en GBP). | 9,48 % | 5,05 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Diversified Income ESG Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'instruments à revenu fixe assortis d'échéances diverses. Le Fonds cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales de diverses manières dans des conditions de marché normales, comme indiqué dans le Supplément du Fonds, et cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Le positionnement sur les taux d'intérêt a contribué à la performance, y compris la sous-pondération de la durée de certains marchés développés au début de l'année.
- » La surpondération du crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, en particulier au cours du quatrième trimestre, car ce crédit a surperformé sur une base ajustée au risque.
- » Les concessions pour nouvelles émissions ont contribué à la performance, car certaines obligations achetées sur le marché primaire à des valorisations attrayantes ont surperformé après l'émission.
- » La sélection de titres au sein des marchés émergents a nuí à la performance, en particulier la sous-pondération de la dette de certains émetteurs souverains qui ont surperformé.
- » La sélection de titres au sein du crédit à rendement élevé a nuí à la performance, notamment la surpondération de certains émetteurs dans les secteurs des télécommunications et de la santé au début de l'année, qui ont sous-performé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 15 décembre 2008) | 7,22 % | 2,52 % |
| Institutions, distribution (lancement le 22 février 2010) | 7,16 % | 2,20 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 24 septembre 2010) | 6,89 % | 1,55 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 24 septembre 2010) | 6,84 % | 1,54 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 21 janvier 2010) | 6,68 % | 1,68 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 mai 2010) | 6,27 % | 1,16 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 11 mai 2010) | 6,20 % | 1,17 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018) | 7,08 % | 1,70 % |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 7,14 % | 1,55 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 septembre 2021) | 8,13 % | (0,13 %) |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³ | 5,20 % | 1,00 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 18 mars 2014) | 6,49 % | 3,03 % |
| Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index | 3,89 % | 1,76 % |
| Catégories libellées en CAD | | |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 21 septembre 2018) | 6,55 % | 1,36 % |
| Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) ⁴ | 4,86 % | 1,71 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 8 septembre 2010) | 2,82 % | 0,15 % |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 avril 2011) | 1,92 % | (0,80 %) |
| Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁵ | 1,49 % | (0,31 %) ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 mai 2009) | 4,98 % | 1,51 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 23 décembre 2009) | 4,95 % | 1,11 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 janvier 2011) | 4,56 % | 0,41 % |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 janvier 2010) | 4,50 % | 0,55 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 novembre 2009) | 4,08 % | 0,21 % |
| G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 14 décembre 2010) | 4,00 % | (0,10 %) |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁶ | 3,29 % | 0,23 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 15 décembre 2009) | 6,55 % | 1,80 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 février 2012) | 6,56 % | 1,49 % |
| Catégorie E en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 18 mars 2010) | 5,59 % | 0,79 % |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁷ | 4,78 % | 0,84 % ² |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 11 avril 2011) | 5,39 % | 1,91 % |
| Indice NIBOR Rate Index à 1 mois | 3,86 % | 1,48 % |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2011) | 4,59 % | 0,58 % |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en SEK) ³ | 3,22 % | 0,45 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

⁴ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR à 1 mois (couvert en CAD) ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA).

⁵ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR CHF à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index.

⁶ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

⁷ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR GBP à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Dynamic Bond Fund vise à optimiser la performance à long terme, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant au moins les deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses. Le Fonds peut investir dans des Titres à revenu fixe de qualité « investment grade » et à rendement élevé, à condition d'investir un maximum de 40 % de ses actifs dans des valeurs ayant une notation inférieure à Baa par Moody's ou BBB par S&P ou une notation équivalente par Fitch (ou, à défaut de notation, jugées de qualité comparable par le Conseiller en investissement). Le Fonds peut investir jusqu'à 50 % de ses actifs dans des Instruments à revenu fixe ayant un lien économique avec des pays émergents.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

» L'exposition aux taux d'intérêt des liquidités aux États-Unis a contribué à la performance, car ils sont restés positifs.

» L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.

» L'exposition longue à la durée américaine dans les parties à court terme et intermédiaire de la courbe a contribué à la performance, car les taux d'intérêt américains sur ces parties de la courbe ont baissé.

» L'exposition longue aux prêts garantis (« CLO ») notés AAA a contribué à la performance, car les écarts sur ces titres se sont resserrés.

» L'exposition courte au zloty polonais a nui à la performance, car la devise s'est appréciée par rapport au dollar américain.

» L'exposition courte à la durée polonaise a nui à la performance, car les taux d'intérêt polonais ont chuté.

» L'exposition longue au yen japonais a nui à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

» L'exposition courte à l'euro a nui à la performance, car la devise s'est appréciée par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|----------|---------------------------|
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 25 février 2016) | (0,34 %) | 2,23 % |
| Institutions, distribution II (lancement le 25 février 2016) | (0,39 %) | 2,23 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 14 août 2020) | (0,75 %) | (2,28 %) |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 février 2016) | (1,35 %) | 1,19 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 10 septembre 2020) | (1,44 %) | (2,76 %) |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 20 octobre 2016) | (1,75 %) | 0,11 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1 ^{er} août 2019) | 0,47 % | 1,76 % |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³ | 3,29 % | 0,09 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| BM Détail en AUD (couverte), distribution II (lancement le 28 avril 2022) | (1,93 %) | (5,27 %) |
| M Détail en AUD (couverte), distribution II (lancement le 8 avril 2021) | (0,97 %) | (5,65 %) |
| Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index | 3,89 % | 1,88 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 14 mars 2018) | (2,52 %) | 0,07 % |
| Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁴ | 1,49 % | (0,30 %) |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 février 2016) | 1,03 % | 3,13 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2019) | 1,01 % | 2,48 % |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁵ | 4,78 % | 1,07 % ² |
| Catégories libellées en ILS | | |
| Institutions en ILS (couverte), capitalisation (lancement le 27 septembre 2022) | 0,10 % | (0,40 %) |
| Taux sans risque au jour le jour du Shekel SHIR | 4,60 % | 4,25 % |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 30 juillet 2021) | 0,23 % | (5,23 %) |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 18 décembre 2020) | (0,85 %) | (4,29 %) |
| Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA | 3,76 % | 1,80 % ² |
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions en USD (couverte), capitalisation (lancement le 25 février 2016) | 1,98 % | 4,31 % |
| Institutions en USD (couverte), distribution II (lancement le 30 avril 2021) | 1,93 % | (3,64 %) |
| BM Détail en USD (couverte), distribution II (lancement le 28 avril 2022) | (0,06 %) | (3,71 %) |
| Catégorie E en USD (couverte), capitalisation (lancement le 15 mars 2017) | 1,04 % | 2,27 % |
| H Institutions en USD (couverte), capitalisation (lancement le 5 août 2020) | 1,78 % | (0,77 %) |
| M Détail en USD (couverte), distribution II (lancement le 8 janvier 2020) | 1,00 % | 0,76 % |
| Catégorie T en USD (couverte), capitalisation (lancement le 9 septembre 2021) | 0,59 % | (6,51 %) |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ⁶ | 5,20 % | 1,70 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

⁴ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR CHF à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index.

⁵ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR GBP à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.

⁶ La performance de l'indice de référence du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Dynamic Multi-Asset Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds s'exposera à une grande variété de catégories d'actifs, tels que des Titres de capital (tels que définis dans le Prospectus) et des titres liés à des actions, des Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) et des devises, ainsi que des instruments liés à des matières premières et des instruments liés à des actifs immobiliers (mais pas directement dans des matières premières et des actifs immobiliers) prévus par la politique d'investissement du Fonds, telle que décrite dans le Prospectus. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition longue à certaines devises des marchés émergents a contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées face à l'euro.
- » L'exposition longue aux actions taiwanaises a contribué à la performance, car les cours ont augmenté.
- » L'exposition longue à la duration britannique en deuxième moitié de période a contribué à la performance, car les rendements britanniques ont chuté.
- » L'exposition courte aux actions européennes a nui à la performance, car les cours ont augmenté.
- » L'exposition courte aux actions américaines au cours de la première moitié de la période a nui à la performance, car les cours ont augmenté.
- » L'exposition longue aux titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (« TIPS ») a nui à la performance, les prévisions en matière de point mort d'inflation aux États-Unis ayant été revues à la baisse.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 11 décembre 2007) | 15,91 % | 2,40 % |
| Institutions, distribution (lancement le 18 avril 2008) | 15,84 % | 2,21 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 août 2010) | 15,42 % | 0,72 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 19 novembre 2008) | 14,74 % | 3,10 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 8 juillet 2010) | 14,64 % | 0,40 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 26 février 2021) | 15,62 % | 1,01 % |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 18 novembre 2008) | 16,90 % | 4,97 % |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert) | 12,70 % | 2,08 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2010) | 12,03 % | 2,81 % |
| Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 23 juin 2010) | 11,90 % | 2,27 % |
| Investisseurs en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 20 décembre 2019) | 11,54 % | 0,83 % |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2009) | 10,85 % | 3,17 % |
| Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2018) | 10,92 % | 3,35 % |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR) | 8,89 % | 3,81 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juin 2008) | 9,40 % | 5,42 % |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP) | 6,34 % | 5,05 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Emerging Local Bond Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investira normalement au moins 80 % de ses actifs dans des Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés dans des devises de pays possédant des marchés émergents de valeurs mobilières, qui peuvent être représentés par des contrats à terme ou des produits dérivés tels que des options, des contrats à terme standardisés ou des swaps.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La surpondération de la duration locale de la République dominicaine a contribué à la performance, car les rendements locaux dominicains ont chuté.
- » La sous-pondération de la lire turque a contribué à la performance, cette devise s'étant affaiblie.
- » La surpondération de la duration européenne et australienne a contribué à la performance, car les rendements européens et australiens ont chuté.
- » L'exposition au rouble russe par le biais d'obligations locales russes a nui à la performance, le rouble s'étant affaibli.
- » La sous-pondération du zloty polonais a nui à la performance, la devise polonaise s'étant raffermie.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 15,61 % | 15,05 % |
| Institutions, distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 15,64 % | 15,07 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 15,15 % | 14,65 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 15,25 % | 14,68 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 14,43 % | 13,93 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 14,41 % | 13,88 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 23 septembre 2022) | 16,71 % | 19,71 % |
| Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index | 14,06 % | 13,94 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 11,68 % | 8,18 % |
| Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 11,61 % | 8,20 % |
| Investisseurs en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 11,29 % | 7,84 % |
| Investisseurs en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 11,23 % | 7,82 % |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 10,62 % | 7,16 % |
| Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 10,63 % | 7,13 % |
| Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR) | 10,20 % | 7,16 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 28 juin 2023) | — | 4,54 % |
| Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP) | — | 3,84 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Emerging Local Bond ESG Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investira normalement au moins 80 % de ses actifs dans des Instruments à revenu fixe libellés dans des devises de pays possédant des marchés émergents de valeurs mobilières. Le Fonds cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales de diverses manières dans des conditions de marché normales, comme indiqué dans le Supplément du Fonds, et cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La surpondération de la duration américaine, européenne et australienne a contribué à la performance, car les rendements américains, européens et australiens ont chuté.
- » La surpondération de la duration locale de la République dominicaine a contribué à la performance, car les rendements locaux dominicains ont chuté.
- » La sous-pondération de la lire turque a contribué à la performance, cette devise s'étant affaiblie.
- » La sous-pondération de la duration locale chinoise a nui à la performance, car les rendements locaux chinois ont chuté.
- » La sous-pondération de la duration locale roumaine a nui à la performance, les rendements locaux roumains ayant chuté.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 juillet 2001) | 11,76 % | 7,49 % |
| Institutions, distribution (lancement le 13 décembre 2001) | 11,73 % | 6,89 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 25 avril 2002) | 11,38 % | 6,16 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 29 mai 2003) | 11,22 % | 5,13 % |
| BM Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023) | — | 0,32 % |
| BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022) | 9,65 % | 1,88 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 10,76 % | 3,89 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005) | 10,80 % | 4,04 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 17 octobre 2002) | 11,57 % | 7,03 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 3 septembre 2020) | 11,61 % | (2,07 %) |
| M Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023) | — | 0,32 % |
| M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010) | 10,80 % | 2,69 % |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013) | 10,72 % | 2,06 % |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 18 novembre 2008) | 12,66 % | 7,14 % |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 10,45 % | 6,73 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| M Détail en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 décembre 2012) | 8,81 % | 1,34 % |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en AUD) | 8,20 % | 2,12 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 16 décembre 2005) | 6,94 % | 2,78 % |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en CHF) | 5,50 % | 2,90 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2002) | 9,24 % | 5,46 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 20 décembre 2010) | 9,16 % | 2,24 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 décembre 2019) | 8,82 % | (2,90 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 8,27 % | 2,56 % |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en EUR) | 7,78 % | 5,30 % ² |
| Catégories libellées en EUR (non couvertes) | | |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 9 février 2018) | 8,00 % | 3,36 % |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (non couvert en EUR) | 6,71 % | 3,09 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 5 février 2004) | 10,85 % | 5,21 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 10,90 % | 4,27 % |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en GBP) | 9,23 % | 5,36 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2018) | 10,02 % | 1,53 % |
| Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 15 février 2007) | 9,09 % | 2,97 % |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en SGD) | 8,60 % | 4,17 % ² |

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Afin d'optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements, le Fonds Emerging Markets Bond Fund investit au moins 80 % de ses actifs dans des Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) d'émetteurs liés économiquement aux pays ayant des marchés de valeurs mobilières émergents.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition tactique à la durée des marchés émergents en devise locale et en euro a contribué à la performance, car les taux d'intérêt ont baissé dans les parties à moyen et long termes des courbes.
- » La surpondération de la dette souveraine vénézuélienne a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La surpondération de la dette d'entreprises ukrainienne a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La sous-pondération des écarts des marchés émergents a nuí à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La sélection de titres dans le secteur de la dette des entreprises chinoises a nuí à la performance, les écarts s'étant creusés.

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 16 avril 2010) | 10,54 % | 3,31 % |
| Institutions, distribution (lancement le 10 juillet 2019) | 10,60 % | (0,91 %) |
| Administrations, capitalisation (lancement le 10 juillet 2019) | 10,08 % | (1,40 %) |
| Administrations, distribution (lancement le 10 juillet 2019) | 10,05 % | (1,41 %) |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 5 février 2021) | 9,73 % | (5,60 %) |
| Catégorie E, distribution (lancement le 5 février 2021) | 9,60 % | (5,64 %) |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1 ^{er} mars 2023) | — | 10,60 % |
| Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified ³ | 10,26 % | 3,78 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 9 avril 2021) | 5,75 % | (6,68 %) |
| Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en CHF) ³ | 5,31 % | (6,42 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 octobre 2013) | 8,13 % | 0,49 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2017) | 8,14 % | (1,83 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 août 2018) | 7,19 % | (1,77 %) |
| Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en EUR) ³ | 7,59 % | 0,96 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2019) | 9,65 % | (2,53 %) |
| Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en GBP) ³ | 9,03 % | (2,79 %) |
| Catégories libellées en GBP (non couvertes) | | |
| Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2020) | 4,25 % | (3,26 %) |
| Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (non couvert en GBP) ³ | 4,04 % | (2,93 %) |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Investisseurs en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 17 mars 2014) | 8,04 % | 1,20 % |
| Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en NOK) ³ | 7,80 % | 1,73 % |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Investisseurs en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 6 février 2014) | 7,83 % | 0,25 % |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021) | 7,66 % | (7,72 %) |
| Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en SEK) ³ | 7,56 % | 0,98 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 1^{er} août 2019 : Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global ajusté pour tenir compte du filtre ISR (Investissement socialement responsable) ; à partir du 2 août 2019 : Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements et un investissement durable (en intégrant explicitement des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance au processus d'investissement, comme décrit plus en détail dans le Supplément), en investissant au moins 80 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié activement géré, composé d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) d'émetteurs liés économiquement aux pays ayant des marchés de valeurs mobilières émergents. L'exposition à ces émetteurs peut être obtenue par un investissement direct dans des Titres à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) ou par le recours à des instruments financiers dérivés (tels que décrits dans le Supplément du Fonds). Tous les titres seront sélectionnés conformément au processus de filtrage interne de durabilité du Conseiller en investissement conçu pour prendre en compte les facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) et qui comprend une stratégie d'exclusion fournie périodiquement par le Conseiller en opérations socialement responsables (comme défini dans le Prospectus).

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition tactique à la durée des marchés émergents en devise locale et en euro a contribué à la performance, car les taux d'intérêt ont baissé dans les parties à moyen et long termes des courbes.
- » La surpondération de la dette d'entreprises ukrainienne a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La sous-pondération de la dette saoudienne a contribué à la performance, car les écarts se sont creusés.
- » La sous-pondération des écarts des marchés émergents a nui à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La sélection de titres dans le secteur de la dette d'entreprises chinoises a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 12 novembre 2009) | 6,85 % | 3,62 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 février 2012) | 5,90 % | 1,83 % |
| Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) | 8,53 % | 4,89 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 mai 2012) | 1,45 % | (0,17 %) |
| Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (couvert en CHF) | 3,95 % | 1,92 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 19 février 2010) | 4,56 % | 2,21 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mars 2010) | 3,70 % | 1,19 % |
| Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (couvert en EUR) | 6,11 % | 3,41 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund vise à optimiser la performance totale tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant dans des circonstances normales au moins 80 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié activement géré composé d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) liés économiquement aux pays émergents et, notamment, d'Instruments à revenu fixe émis par des sociétés liées économiquement à des pays émergents.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition tactique à la durée des marchés émergents en devise locale et en euro a contribué à la performance, car les taux d'intérêt ont baissé dans les parties à moyen et long termes des courbes.
- » La sélection de titres dans le secteur de la dette des entreprises ukrainiennes a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La sous-pondération dans le secteur de la dette des entreprises zambiennes a contribué à la performance, les écarts s'étant creusés.
- » La sous-pondération des écarts des marchés émergents a nui à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La sélection de titres dans le secteur de la dette des entreprises chinoises a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 4 juin 2019) | 11,91 % | 3,02 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 2 octobre 2023) | — | 7,80 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 2 octobre 2023) | — | 7,79 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 8 juin 2022) | 12,67 % | 8,06 % |
| 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index et 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD) | 11,60 % | 0,47 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 4 juin 2019) | 9,25 % | 1,34 % |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 19 avril 2022) | 8,24 % | 0,70 % |
| 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en EUR) et 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR) | 8,38 % | (0,37 %) ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (partiellement couverte), distribution (lancement le 29 mars 2022) | 9,58 % | 2,70 % |
| 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en GBP) et 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP) | 7,84 % | 2,54 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund vise à optimiser sa performance totale tout en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant dans une combinaison de titres à revenu fixe (similaires à des prêts et versant un taux d'intérêt fixe ou variable) d'émetteurs publics ou privés présentant un lien économique avec des pays émergents, dans des produits dérivés liés à ces titres à revenu fixe et dans des devises de marchés émergents.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La surpondération de la durée locale de la République dominicaine a contribué à la performance, car les rendements locaux dominicains ont chuté.
- » La surpondération de la durée européenne et australienne a contribué à la performance, car les rendements européens et australiens ont chuté.
- » La sous-pondération de la lire turque a contribué à la performance, cette devise s'étant affaiblie.
- » La sous-pondération du zloty polonais a nui à la performance, la devise polonaise s'étant raffermie.
- » La sous-pondération du peso mexicain a nui à la performance, la devise mexicaine s'étant raffermie.

Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 19 novembre 2008) | 9,21 % | 1,56 % |
| Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert) | 8,44 % | 1,44 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2010) | 6,46 % | 2,95 % |
| Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2009) | 5,46 % | 2,39 % |
| Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en EUR) | 4,77 % | 2,93 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant au moins 80 % de ses actifs dans des devises de marchés émergents ou des Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés dans des devises de marchés émergents. Le Conseiller en investissement dispose d'un large pouvoir discrétionnaire pour identifier les pays qu'il estime éligibles au statut de marchés émergents. Le Conseiller en investissement sélectionnera la composition du Fonds en termes géographiques et de devises en s'appuyant sur l'évaluation des taux d'intérêt relatifs, des taux d'inflation, des taux de change, des politiques monétaires et budgétaires, des balances commerciales et soldes de compte courant et d'autres facteurs précis que le Conseiller en investissement juge pertinents. Il est probable que le Fonds concentre ses investissements sur l'Asie, l'Afrique, le Moyen-Orient, l'Amérique latine et les pays émergents d'Europe. Le Fonds pourra investir dans des instruments dont le rendement dépend de celui d'un titre d'un marché émergent tel qu'un instrument dérivé, plutôt que d'investir directement dans des valeurs des marchés émergents. La durée moyenne du portefeuille de ce Fonds varie en fonction des prévisions du Conseiller en investissement en matière de taux d'intérêt et, dans des conditions de marché normales, ne devrait pas être supérieure à deux ans. Le Fonds peut investir la totalité de ses actifs en valeurs à rendement élevé, à condition d'investir un maximum de 15 % de ses actifs dans des valeurs ayant une notation inférieure à B par Moody's ou S&P ou une notation équivalente par Fitch (ou, à défaut de notation, jugées de qualité comparable par le Conseiller en investissement).

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sous-pondération de la lire turque a contribué à la performance, cette devise s'étant affaiblie.
- » L'exposition hors indice à la durée locale de la République dominicaine a contribué à la performance, car les rendements locaux dominicains ont chuté.
- » La surpondération du forint hongrois a contribué à la performance, la devise hongroise s'étant raffermie.
- » La sous-pondération du zloty polonais a nuí à la performance, la devise polonaise s'étant raffermie.
- » La surpondération de la couronne tchèque a nuí à la performance, la devise s'étant affaiblie au second semestre.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2021) | 5,95 % | (0,08 %) |
| Institutions, distribution (lancement le 29 avril 2021) | 5,98 % | (0,07 %) |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 29 avril 2021) | 4,96 % | (0,98 %) |
| Catégorie E, distribution (lancement le 29 avril 2021) | 4,91 % | (1,01 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index | 5,53 % | (2,72 %) |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 novembre 2021) | 4,04 % | (1,76 %) |
| Catégorie R en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021) | 3,88 % | (1,36 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD) | 3,53 % | (3,97 %) ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 29 avril 2021) | 1,43 % | (2,91 %) |
| Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021) | 0,43 % | (3,78 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF) | 0,82 % | (5,71 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 avril 2021) | 3,60 % | (1,90 %) |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 21 mai 2021) | 3,57 % | (1,99 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 juin 2021) | 2,67 % | (3,13 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021) | 2,63 % | (2,79 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR) | 3,01 % | (4,71 %) ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021) | 5,08 % | (0,79 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP) | 4,47 % | (3,58 %) |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} mars 2023) | — | 3,68 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en NOK) | — | 3,98 % |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 29 octobre 2021) | 3,59 % | (2,31 %) |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 12 mai 2022) | 3,09 % | 0,14 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SEK) | 3,07 % | (5,91 %) ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021) | 4,39 % | (0,68 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD) | 3,78 % | (3,43 %) |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO ESG Income Fund vise un revenu courant élevé, tout en appliquant une gestion prudente des investissements et un investissement durable (en intégrant explicitement des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG ») au processus d'investissement, comme décrit plus en détail dans le Supplément). L'appréciation du capital à long terme est un objectif secondaire.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition longue aux taux d'intérêt des liquidités aux États-Unis a contribué à la performance, du fait du portage.
- » L'exposition longue au crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au crédit à rendement élevé a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » Les positions sur des titres adossés à des créances hypothécaires commerciales et émis par des organismes gouvernementaux américains ont pesé sur la performance, car les écarts sur ces titres se sont creusés.
- » L'exposition courte à la duration japonaise dans la partie intermédiaire de la courbe a nuï à la performance, car les taux d'intérêt japonais ont chuté.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 décembre 1998) | 7,88 % | 3,44 % |
| Institutions, distribution (lancement le 7 janvier 2003) | 7,84 % | 3,12 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 8 mai 2002) | 7,47 % | 3,04 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 6,90 % | 1,80 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 10 octobre 2005) | 6,85 % | 1,59 % |
| Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index | 7,25 % | 3,22 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2006) | 5,63 % | 1,88 % |
| Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index (couvert en CHF) | 5,00 % | 1,88 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objetif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Euro Bond Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés en euro et assortis d'échéances diverses. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Le positionnement sur la courbe au sein du bloc euro, à savoir la surpondération de la partie médiane de la courbe, a contribué à la performance relative, car les taux d'intérêt ont chuté.
- » L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles britanniques et européennes et de prêts garantis (CLO) européens, a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » Le positionnement sur la durée des taux américains, y compris l'exposition longue en fin d'année, a contribué à la performance relative, les rendements ayant chuté en novembre et décembre.
- » La sélection de titres dans le secteur du capital bancaire a nuí à la performance, l'exposition à la dette subordonnée, en particulier celle d'une banque suisse, ayant sous-performé.
- » L'exposition courte à la durée du Japon au début de l'année a nuí à la performance relative du fait de la chute des rendements.
- » La sous-pondération des obligations d'entreprises non financières de qualité « investment grade » a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2008) | 9,21 % | 2,81 % |
| Institutions, distribution II (lancement le 1 ^{er} octobre 2013) | 9,19 % | 1,52 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 mai 2010) | 8,23 % | 1,41 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 7 juin 2019) | 9,32 % | (1,39 %) |
| H Institutions, distribution II (lancement le 7 juin 2019) | 9,34 % | (1,39 %) |
| Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index | 7,81 % | 2,62 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Euro Credit Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés en euro et assortis d'échéances diverses, qui peuvent être représentés par des participations directes ou indirectes dans des Titres à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) liés à des crédits ou des instruments dérivés tels que des options, des swaps de contrats à terme standardisés ou des swaps de défaillance. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Les stratégies macro ont contribué à la performance en raison de la position sur la duration dans les marchés développés.
- » La sélection de titres dans le secteur bancaire et du courtage a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé.
- » La sélection de titres au sein de la dette extérieure des marchés émergents a contribué à la performance, car un émetteur surpondéré a surperformé.
- » L'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires a nui à la performance, car le secteur a enregistré une sous-performance.
- » La sous-pondération du secteur de l'automobile a nui à la performance, ce secteur ayant surperformé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 février 2011) | 8,71 % | 3,26 % |
| Institutions, distribution (lancement le 28 février 2011) | 8,60 % | 3,27 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 13 décembre 2019) | 8,41 % | (0,83 %) |
| Investisseurs, distribution (lancement le 29 mai 2012) | 8,29 % | 2,89 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 février 2011) | 7,69 % | 2,34 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 février 2011) | 7,74 % | 2,34 % |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 7,28 % | 0,33 % |
| Catégorie T, distribution (lancement le 30 septembre 2014) | 7,32 % | 0,33 % |
| Indice Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index | 6,39 % | 1,83 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Euro Income Bond Fund vise à optimiser le revenu courant, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. L'appréciation du capital à long terme est un objectif secondaire. Le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'obligations et autres Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés en euro et assortis d'échéances diverses. Le Fonds vise à maintenir un niveau élevé de dividendes en investissant dans une large variété de secteurs à revenu fixe qui, selon le Conseiller en investissement, génèrent habituellement des revenus élevés. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux taux d'intérêt européens des liquidités a contribué à la performance, car ils sont restés positifs.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue aux taux d'intérêt européens a contribué à la performance, car ces taux ont baissé.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprise à rendement élevé a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis a pesé sur la performance, car les écarts sur ces titres se sont creusés.
- » L'exposition longue à la dette libellée en dollar américain en Chine a nui à la performance, le cours de ces titres s'étant déprécié.
- » L'exposition longue au yen japonais et au dollar australien a nui à la performance, car ces devises se sont dépréciées par rapport à l'euro.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 21 avril 2006) | 10,09 % | 4,27 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 3 novembre 2023) | — | 13,30 % |
| Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index ³ | 9,04 % | 3,21 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Euro Long Average Duration Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 mars 2011 : Indice Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index ; du 31 mars 2011 au 30 janvier 2012 : Indice Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index ; à partir du 31 janvier 2012 : Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Euro Long Average Duration Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés en euro. Dans des conditions normales de marché, les deux tiers au moins de la durée du Fonds seront dérivés de l'exposition à des Instruments à revenu fixe émis par un gouvernement ou liés à celui-ci, libellés en euro.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Le positionnement sur la courbe au sein du bloc euro, à savoir la surpondération de la partie médiane de la courbe, ainsi que la sélection des instruments, ont contribué à la performance, car les taux d'intérêt ont chuté.
- » L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles britanniques et européennes et de prêts garantis (CLO) européens, a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » Le positionnement au Japon au début de l'année, associant une sous-pondération de la durée japonaise et une surpondération de la devise japonaise (JPY), a nui à la performance, les taux d'intérêt japonais ayant chuté et le yen japonais s'étant affaibli par rapport au dollar américain (la devise de financement).
- » L'exposition longue aux créances hypothécaires danoises au début de l'année a pesé sur la performance relative, les écarts s'étant creusés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2006) | 4,40 % | 1,18 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 3,65 % | 0,42 % |
| Indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index ³ | 3,18 % | 0,84 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Euro Short-Term Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 mois ; du 1^{er} juillet 2021 au 31 août 2023 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ; à partir du 1^{er} septembre 2023 : Indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Euro Short-Term Fund vise à optimiser les revenus courants tout en préservant le capital et la liquidité journalière. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés en euro et assortis d'échéances diverses, sachant que la durée moyenne du portefeuille n'est pas censée dépasser un an et demi. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles britanniques et européennes et de prêts garantis (CLO) européens, a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » Le positionnement sur la durée dans la zone euro, y compris l'exposition longue au cours du quatrième trimestre, a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant chuté au cours du quatrième trimestre.
- » Le positionnement sur la durée aux États-Unis, y compris l'exposition longue en mai et juin, a nuí à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté en mai et juin.
- » L'exposition longue au yen japonais a nuí à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| Catégories libellées en EUR | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2020) | 13,77 % | 2,63 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 22 décembre 2022) | 12,80 % | 12,47 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 17 avril 2023) | — | 9,70 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 31 janvier 2020) | 14,47 % | 3,19 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index | 12,44 % | 1,17 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investit au moins les deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'instruments à revenu fixe à haut rendement qui ont une notation inférieure à BBB par S&P, ou une notation équivalente par Moody's ou Fitch ou, s'ils ne sont pas notés, jugés de qualité comparable par le Conseiller en investissement. Dans des conditions de marché normales, le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de ses actifs dans des Instruments à revenu fixe à haut rendement notés CCC ou moins par S&P, ou notés de manière équivalente par Moody's ou Fitch, ou, s'ils ne sont pas notés, jugés de qualité comparable par le Conseiller en investissement. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sous-pondération et la sélection de titres dans le secteur de la finance et du courtage ont contribué à la performance, car le secteur, ainsi que certains émetteurs sous-pondérés ont sous-performé le marché dans son ensemble.
- » La sélection de titres au sein du secteur de la santé a contribué à la performance, car certains émetteurs surpondérés ont surperformé.
- » La sélection de titres dans le secteur des télécommunications filaires a contribué à la performance, car un émetteur surpondéré a surperformé.
- » La sélection de titres dans le secteur bancaire a nuï à la performance, l'exposition à la dette subordonnée, et en particulier celle d'une banque suisse, ayant sous-performé.
- » La sous-pondération et la sélection de titres dans le secteur de l'alimentation et des boissons ont nuï à la performance, car le secteur a surperformé le marché dans son ensemble tandis qu'un émetteur en particulier a sous-performé.

Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 5 juillet 2011) | 4,18 % | 1,10 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 mars 2013) | 3,72 % | (0,22 %) |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 8 janvier 2020) | 3,98 % | (0,18 %) |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³ | 3,31 % | 1,16 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 29 septembre 2012 : Indice PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index ; du 30 septembre 2012 au 16 janvier 2020 : Indice Bloomberg Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index ; à partir du 17 janvier 2020 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index. Le rendement de l'indice de référence depuis le lancement est calculé depuis le 30 juin 2011.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investit au moins les deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe libellés en devises paneuropéennes (c'est-à-dire dans les différentes devises d'Europe) et assortis d'échéances diverses. La durée moyenne de portefeuille du Fonds variera normalement de 0 à 5 ans en fonction des prévisions en matière de taux d'intérêt du Conseiller en investissement.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles britanniques et européennes et de prêts garantis (CLO) européens, a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition longue à la durée européenne a contribué à la performance, car les taux d'intérêt ont chuté.
- » L'exposition longue aux titres financiers senior a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition longue aux obligations couvertes danoises a nuí à la performance, les écarts s'étant creusés.
- » L'exposition longue aux points morts italiens et américains a nuí à la performance, les prévisions d'inflation ayant été revues à la baisse.
- » L'exposition courte à la durée du Japon au début de l'année a nuí à la performance du fait de la chute des rendements.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 9 juin 2009) | 7,45 % | 2,47 % |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres) | 6,63 % | 1,94 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (partiellement couverte), distribution (lancement le 2 août 2011) | 1,76 % | 1,17 % |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en CHF) (clôture de la Bourse de Londres) | 0,87 % | 0,62 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 24 mai 2010) | 4,98 % | 2,23 % |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 6 mai 2010) | 3,96 % | 1,23 % |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en EUR) (clôture de la Bourse de Londres) | 4,18 % | 1,76 % ² |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Institutions en NOK (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 5 mars 2012) | 7,34 % | 3,56 % |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en NOK) (clôture de la Bourse de Londres) | 6,59 % | 3,07 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global Advantage Fund vise à optimiser la performance à long terme, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant 80 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) et qui sont liés économiquement à trois pays au moins (dont les États-Unis peuvent faire partie).

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition choisie à la dette extérieure des marchés émergents a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » Le positionnement sur la durée des taux du bloc euro, y compris la sous-pondération au cours des 10 premiers mois de l'année, a contribué à la performance relative, les rendements ayant augmenté au cours de la même période.
- » La sélection de titres dans le secteur financier a contribué à la performance relative, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé le marché dans son ensemble.
- » La sous-pondération du crédit d'entreprises de qualité « investment grade » hors services financiers a nuí à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » La sous-pondération de la durée chinoise a nuí à la performance relative du fait de la baisse des rendements.
- » Le positionnement sur les devises des marchés développés, principalement par le biais d'une exposition longue au yen japonais, a nuí à la performance relative, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 12 mars 1998) | 8,05 % | 4,88 % |
| Institutions, distribution (lancement le 18 avril 2001) | 8,01 % | 4,56 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 1 ^{er} mars 1999) | 7,68 % | 4,37 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 23 janvier 2001) | 7,66 % | 4,20 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 14 juin 2004) | 7,51 % | 3,88 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 7,10 % | 3,37 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005) | 7,08 % | 3,33 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002) | 7,87 % | 4,24 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020) | 7,86 % | (0,22 %) |
| M Détail, distribution II (lancement le 26 avril 2017) | 7,08 % | 1,14 % |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014) | 6,68 % | 1,38 % |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014) | 6,76 % | 1,38 % |
| Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 8,14 % | (0,90 %) |
| Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020) | 8,18 % | (0,90 %) |
| Catégorie W, distribution II (lancement le 23 février 2023) | — | 6,54 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) ³ | 7,15 % | 4,14 % ² |
| Catégories libellées en USD (exposition au risque de change) | | |
| Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 13 décembre 2002) | 6,90 % | 3,81 % |
| Institutions (exposition au risque de change), distribution (lancement le 23 mars 2006) | 6,87 % | 3,41 % |
| Catégorie E (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 19 mai 2010) | 5,96 % | 1,51 % |
| Catégorie E (exposition au risque de change), distribution (lancement le 19 mai 2010) | 5,86 % | 1,51 % |
| H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 26 février 2021) | 6,73 % | (4,70 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en USD) ³ | 5,72 % | 2,95 % ² |
| Catégories libellées en CAD | | |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 21 septembre 2018) | 7,22 % | 1,54 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CAD) ³ | 6,33 % | 1,22 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 8 mai 2003) | 3,50 % | 2,32 % |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 10 avril 2003) | 3,51 % | 2,36 % |
| Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 juin 2011) | 3,12 % | 1,39 % |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 13 juin 2018) | 2,58 % | (1,61 %) |
| Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 3,60 % | (3,35 %) |
| Catégorie W en CHF (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 3,64 % | (3,33 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF) ³ | 2,52 % | 1,51 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 avril 2003) | 5,71 % | 3,33 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 avril 2005) | 5,71 % | 3,18 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 février 2005) | 5,33 % | 2,82 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 4,76 % | 2,37 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2016) | 4,74 % | (0,39 %) |
| G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2012) | 4,78 % | 0,33 % |
| Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 5,40 % | 0,96 % |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 4,41 % | (0,33 %) |
| Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 5,77 % | (2,53 %) |
| Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 5,82 % | (2,49 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR) ³ | 4,73 % | 2,46 % ² |

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global Bond Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds vise à atteindre son objectif d'investissement en investissant au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés dans les principales devises mondiales.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Le positionnement sur la courbe au sein du bloc euro, en particulier la surpondération de la partie intermédiaire de la courbe, a contribué à la performance relative, les rendements ayant chuté au troisième et quatrième trimestres.
- » La sélection des instruments au sein du bloc euro, à savoir la préférence pour les swaps de taux d'intérêt lorsque les écarts sur swaps se sont resserrés, a contribué à la performance relative.
- » La surpondération de la durée au sein du bloc dollar, en particulier en Australie au cours des premier et quatrième trimestres, a contribué à la performance relative, les rendements ayant chuté.
- » La sous-pondération du crédit de qualité « investment grade » hors services financiers a nui à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue au yen japonais a nui à la performance relative, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.
- » La sous-pondération de la durée en Chine a nui à la performance relative du fait de la chute des rendements.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹ (suite)

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|----------|---------------------------|
| Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change) | | |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 20 février 2013) | 3,35 % | 2,65 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en EUR) ³ | 2,14 % | 2,07 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2003) | 7,26 % | 4,33 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} juin 2004) | 7,27 % | 4,34 % |
| Investisseurs en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 14 avril 2005) | 6,90 % | 3,71 % |
| Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 7,44 % | (1,41 %) |
| Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 7,39 % | (1,44 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en GBP) ³ | 6,22 % | 3,51 % ² |
| Catégories libellées en GBP (exposition au risque de change) | | |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 9 mars 2018) | 0,94 % | 1,28 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP) ³ | (0,25 %) | 0,88 % |
| Catégories libellées en HKD | | |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 26 avril 2017) | 7,07 % | 1,18 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en HKD) ³ | 7,20 % | 1,68 % |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2005) | 6,03 % | 4,29 % |
| Investisseurs en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 26 juillet 2006) | 5,66 % | 4,24 % |
| Catégorie W en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 13 avril 2021) | 6,13 % | (2,37 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK) ³ | 5,21 % | 3,41 % ² |
| Catégories libellées en NZD | | |
| Institutions en NZD (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} novembre 2004) | 7,55 % | 6,17 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NZD) ³ | 6,59 % | 5,27 % |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 novembre 2004) | 5,73 % | 3,48 % |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2021) | 5,21 % | (3,92 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK) ³ | 4,81 % | 2,55 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 7 août 2009) | 6,48 % | 4,27 % |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 février 2023) | — | 5,12 % |
| M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 février 2023) | — | 4,26 % |
| Catégorie W en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 février 2023) | — | 5,23 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SGD) ³ | 5,49 % | 2,81 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Global Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 novembre 2000 : Indice JPMorgan GBI Global Index (couvert en USD) ; à partir du 1^{er} décembre 2000 : Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD).

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|----------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 12 janvier 2017) | 7,46 % | 1,87 % |
| Institutions, distribution (lancement le 3 avril 2020) | 7,53 % | 0,26 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 7 novembre 2018) | 7,13 % | 1,54 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 8 mars 2019) | 6,48 % | 0,48 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) | 7,15 % | 1,67 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017) | 6,20 % | 1,81 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en AUD) | 5,31 % | 1,09 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017) | 2,94 % | (0,81 %) |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} septembre 2022) | 2,07 % | (1,05 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF) | 2,52 % | (1,06 %) ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017) | 5,11 % | (0,17 %) |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017) | 5,12 % | (0,18 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 février 2017) | 4,26 % | (1,05 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR) | 4,73 % | (0,40 %) ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2020) | 6,76 % | (1,02 %) |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017) | 6,74 % | 0,88 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) libellé en GBP | 6,22 % | 0,65 % ² |
| Catégories libellées en GBP (exposition au risque de change) | | |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change), distribution (lancement le 4 août 2022) | 0,31 % | (2,64 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP) | (0,25 %) | (3,20 %) |
| Catégories libellées en GBP (non couvertes) | | |
| Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2020) | 1,32 % | (0,90 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP) | 1,10 % | (0,48 %) |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017) | 5,44 % | 0,92 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK) | 5,21 % | 0,77 % |
| Catégories libellées en NZD | | |
| Institutions en NZD (couverte), distribution (lancement le 5 avril 2017) | 7,02 % | 1,60 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NZD) | 6,59 % | 1,48 % |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 20 mai 2021) | 5,17 % | (3,35 %) |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 18 mai 2023) | — | 3,14 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK) | 4,81 % | (3,18 %) ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global Bond ESG Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements et un investissement durable (en intégrant explicitement les facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance au processus d'investissement, comme indiqué dans le Supplément). Le Fonds vise à atteindre son objectif d'investissement en investissant au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés dans les principales devises mondiales.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Le positionnement sur la duration des taux du bloc euro, avec une sous-pondération au cours des 10 premiers mois de l'année suivie d'une surpondération à la fin de l'année, a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté tout au long de l'année avant de chuter au cours des deux derniers mois.
- » La sélection de titres dans le secteur financier a contribué à la performance relative, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé le marché dans son ensemble.
- » La surpondération de la duration du bloc dollar, en particulier de la partie médiane de la courbe en Australie, a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt ayant chuté.
- » Le positionnement sur les devises des marchés développés, à savoir l'exposition longue au yen japonais, a nuï à la performance relative, car le yen s'est déprécié par rapport au dollar américain.
- » La sous-pondération de la duration chinoise a nuï à la performance relative, car les taux d'intérêt ont chuté.
- » La sous-pondération du crédit d'entreprises de qualité « investment grade » hors services financiers a nuï à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 mars 2003) | 9,53 % | 4,41 % |
| Institutions, distribution (lancement le 9 novembre 2005) | 9,48 % | 4,47 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 février 2006) | 9,16 % | 4,07 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 14 septembre 2004) | 8,97 % | 4,04 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 30 avril 2008) | 8,52 % | 3,60 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018) | 9,34 % | 1,90 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 30 octobre 2019) | 10,04 % | 1,22 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) ³ | 8,32 % | 3,48 % ² |
| Catégories libellées en USD (exposition au risque de change) | | |
| Catégorie E (exposition au risque de change), distribution (lancement le 4 octobre 2016) | 6,42 % | (1,50 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (non couvert en USD) ³ | 5,72 % | (1,33 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 avril 2006) | 7,31 % | 3,63 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en EUR) ³ | 5,99 % | 2,49 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Global Bond Ex-US Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 19 janvier 2016 : Indice FTSE World Government Bond ex-U.S. Index (couvert en USD) ; à partir du 20 janvier 2016 : Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD).

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global Bond Ex-US Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds vise à atteindre son objectif d'investissement en investissant au moins 70 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) d'émetteurs ayant leur siège social ou exerçant la majeure partie de leur activité en dehors des États-Unis, qui représentent au moins trois pays hors États-Unis.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Le positionnement sur la courbe au sein du bloc euro, en particulier la surpondération de la partie intermédiaire de la courbe, a contribué à la performance relative, les rendements ayant chuté au troisième et quatrième trimestres.
- » La sélection des instruments au sein du bloc euro, à savoir la préférence pour les swaps de taux d'intérêt lorsque les écarts sur swaps se sont resserrés, a contribué à la performance relative.
- » La sélection des titres au sein des titres financiers senior a contribué à la performance relative.
- » La sous-pondération de la durée en Chine a nui à la performance relative du fait de la chute des rendements.
- » L'exposition longue au yen japonais a nui à la performance relative, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.
- » La sous-pondération du crédit de qualité « investment grade » hors services financiers a nui à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005) | 13,04 % | 5,98 % |
| Institutions, distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 13,05 % | 6,00 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 22 juin 2016) | 12,63 % | 4,30 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 31 octobre 2023) | — | 8,06 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 27 juin 2008) | 12,47 % | 5,54 % |
| Administrations, distribution (lancement le 11 décembre 2015) | 12,43 % | 4,66 % |
| BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022) | 10,85 % | 3,87 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006) | 12,01 % | 4,97 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006) | 12,05 % | 5,04 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 29 août 2008) | 12,89 % | 6,00 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 22 mars 2013) | 12,75 % | 4,23 % |
| M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010) | 12,05 % | 4,48 % |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013) | 12,08 % | 3,41 % |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 29 août 2008) | 12,78 % | 4,37 % |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014) | 11,57 % | 3,15 % |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014) | 11,60 % | 3,15 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD ³ | 13,24 % | 6,32 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 16 février 2010) | 8,29 % | 4,00 % |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 31 août 2012) | 8,27 % | 2,72 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en CHF ³ | 8,22 % | 4,34 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2008) | 10,58 % | 4,60 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 10,55 % | 4,81 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 janvier 2011) | 10,19 % | 3,47 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 9,60 % | 3,79 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2016) | 9,57 % | 1,60 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en EUR ³ | 10,62 % | 4,96 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 mai 2012) | 12,24 % | 4,42 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 12,06 % | 5,56 % |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 juin 2009) | 11,18 % | 5,41 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en GBP ³ | 12,19 % | 5,73 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 25 avril 2016) | 10,41 % | 3,27 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en SGD ³ | 11,42 % | 4,58 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Global High Yield Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 31 mars 2014 : Indice ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield, BB-B Rated, Constrained Index ; à partir du 1^{er} avril 2014 : Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global High Yield Bond Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins les deux tiers de son actif net total dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe à rendement élevé (tels que définis dans le Prospectus) libellés dans les principales devises mondiales et notés en dessous de Baa par Moody's ou de BBB par S&P, ou une note équivalente par Fitch.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sélection des titres dans le secteur de la finance et du courtage a contribué à la performance, car certains émetteurs sous-pondérés ont sous-performé alors qu'une nouvelle émission d'un émetteur a surperformé.
- » La sous-pondération et la sélection de titres dans le secteur des télécommunications filaires ont contribué à la performance, car le secteur a sous-performé le marché dans son ensemble tandis qu'un émetteur sous-pondéré a sous-performé.
- » La sous-pondération du secteur immobilier, car le secteur a sous-performé le marché dans son ensemble.
- » La sélection de titres dans le secteur bancaire a nuï à la performance, l'exposition à la dette subordonnée, et en particulier celle d'une banque suisse, ayant sous-performé.
- » La sélection de titres dans le secteur des télécommunications sans fil, car un émetteur surpondéré a sous-performé le marché dans son ensemble.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 18 avril 2008) | 9,30 % | 4,35 % |
| Institutions, distribution (lancement le 23 juillet 2003) | 9,19 % | 4,51 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 15 février 2005) | 8,88 % | 3,91 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 22 janvier 2009) | 8,84 % | 4,59 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 21 janvier 2009) | 8,70 % | 4,42 % |
| Administrations, distribution (lancement le 21 janvier 2009) | 8,68 % | 4,43 % |
| BM Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023) | — | 0,17 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 10 décembre 2008) | 8,35 % | 4,20 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 30 avril 2008) | 8,32 % | 3,37 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2008) | 9,09 % | 4,31 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018) | 9,06 % | 1,40 % |
| M Détail, décumulation (lancement le 21 décembre 2023) | — | 0,27 % |
| M Détail, distribution (lancement le 28 septembre 2012) | 8,22 % | 1,79 % |
| M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013) | 8,34 % | 1,97 % |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 9,06 % | 2,31 % |
| Catégorie R, distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 9,02 % | 2,32 % |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014) | 7,89 % | 1,11 % |
| Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 9,41 % | (1,75 %) |
| Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020) | 9,41 % | (1,72 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) | 8,68 % | 3,83 % ² |
| Catégories libellées en USD (exposition au risque de change) | | |
| Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 2 août 2013) | 9,96 % | 1,76 % |
| Institutions (exposition au risque de change), distribution (lancement le 6 septembre 2016) | 9,90 % | 0,86 % |
| H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 26 février 2021) | 9,68 % | (4,24 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (non couvert en USD) | 9,24 % | 1,68 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 7 avril 2020) | 7,26 % | (0,19 %) |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018) | 6,97 % | 0,30 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en AUD) | 6,66 % | 1,13 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 10 décembre 2009) | 4,53 % | 2,06 % |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 6 février 2015) | 4,67 % | (0,31 %) |
| Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 10 mai 2011) | 4,15 % | 0,96 % |
| Investisseurs en CHF (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009) | 4,16 % | 2,80 % |
| Administrations en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 31 janvier 2013) | 3,98 % | (0,07 %) |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 6 mars 2012) | 3,65 % | 0,18 % |
| Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 4,60 % | (4,23 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CHF) | 3,87 % | 2,41 % ² |
| Catégories libellées en CZK | | |
| Institutions en CZK (couverte), distribution (lancement le 19 mai 2015) | 10,71 % | 1,78 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CZK) | 10,00 % | 1,94 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2003) | 6,78 % | 3,51 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 15 septembre 2008) | 6,80 % | 3,46 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 mai 2006) | 6,44 % | 3,00 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009) | 6,49 % | 3,44 % |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 février 2009) | 6,28 % | 3,17 % |

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global Investment Grade Credit Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) d'entreprises de qualité « investment grade ».

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Les stratégies de duration, et en particulier la position sur la duration de l'euro, ont contribué à la performance.
- » La sous-pondération du secteur lié aux gouvernements a contribué à la performance, les organismes gouvernementaux et supranationaux émetteurs ayant sous-performé le marché dans son ensemble sur la base du rendement excédentaire.
- » La sélection de titres dans le secteur des sociétés financières a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé le marché dans son ensemble.
- » La sélection de titres dans le secteur bancaire a nui à la performance, l'exposition à la dette subordonnée, et en particulier celle d'une banque suisse, ayant sous-performé.
- » La sélection de titres au sein de la dette extérieure des marchés émergents a nui à la performance en raison des fluctuations du marché liées à certaines anciennes positions russes.

Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹ (suite)

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Administrations en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 février 2009) | 6,34 % | 3,17 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 5,88 % | 2,39 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 9 septembre 2010) | 5,87 % | 1,26 % |
| Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 6,49 % | 0,73 % |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 5,49 % | (0,66 %) |
| Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 6,98 % | (3,41 %) |
| Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 6,95 % | (3,41 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en EUR) | 6,13 % | 2,80 % ² |
| Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change) | | |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 16 août 2012) | 6,22 % | 2,67 % |
| Catégorie E en EUR (exposition au risque de change), distribution (lancement le 12 décembre 2018) | 5,20 % | 0,70 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (non couvert en EUR) | 5,54 % | 2,77 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 2 septembre 2005) | 8,39 % | 3,94 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 11 juillet 2008) | 8,31 % | 4,10 % |
| Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009) | 8,04 % | 4,11 % |
| Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 janvier 2009) | 7,81 % | 3,92 % |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mars 2009) | 7,46 % | 3,61 % |
| Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 8,04 % | 1,63 % |
| Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020) | 8,47 % | (2,37 %) |
| Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020) | 8,44 % | (2,34 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en GBP) | 7,64 % | 3,37 % ² |
| Catégories libellées en HKD | | |
| Administrations en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017) | 8,85 % | 0,91 % |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017) | 8,30 % | 0,51 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) libellé en HKD | 8,73 % | 1,87 % |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 18 janvier 2012) | 7,15 % | 3,05 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en NOK) | 6,57 % | 2,86 % |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 4 décembre 2009) | 6,83 % | 3,08 % |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 13 décembre 2012) | 6,21 % | 0,68 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SEK) | 6,18 % | 2,67 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015) | 7,53 % | 2,05 % |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018) | 7,26 % | 0,70 % |
| Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 22 septembre 2017) | 7,00 % | 0,20 % |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 18 juillet 2012) | 6,69 % | 1,66 % |
| Catégorie W en SGD (couverte), distribution (lancement le 13 octobre 2020) | 7,62 % | (2,54 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SGD) | 6,91 % | 2,49 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 septembre 2018) | 8,55 % | 2,35 % |
| Institutions, distribution (lancement le 19 juillet 2019) | 8,53 % | 0,66 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mai 2021) | 8,17 % | (2,81 %) |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 février 2020) | 7,60 % | (1,76 %) |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 février 2020) | 7,59 % | (1,76 %) |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 20 juin 2019) | 9,14 % | 1,36 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) | 8,68 % | 2,13 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018) | 3,83 % | (0,46 %) |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020) | 3,85 % | (3,37 %) |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020) | 3,04 % | (4,23 %) |
| Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020) | 2,85 % | (4,26 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CHF) | 3,87 % | (0,71 %) ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018) | 6,18 % | 0,26 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020) | 6,26 % | (2,56 %) |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 janvier 2023) | — | 5,00 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 5 janvier 2023) | — | 5,08 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020) | 5,18 % | (3,47 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020) | 5,14 % | (3,48 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en EUR) | 6,13 % | 0,01 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018) | 7,75 % | 1,30 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} mai 2019) | 7,58 % | 0,43 % |
| Catégorie E en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020) | 6,83 % | (2,51 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en GBP) | 7,64 % | 1,06 % ² |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 3 novembre 2022) | 6,16 % | 8,65 % |
| Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 27 novembre 2019) | 5,64 % | (2,03 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SEK) | 6,18 % | (1,67 %) ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements et un investissement durable (en intégrant explicitement les facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance au processus d'investissement, comme indiqué dans le Supplément). Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe d'entreprises de qualité « investment grade » (tels que définis dans le Prospectus).

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Les stratégies macro ont contribué à la performance en raison de la position sur la duration dans les marchés développés.
- » La sélection de titres au sein de la dette extérieure des marchés émergents, car la surpondération de certaines obligations ESG, a contribué à la performance.
- » La sous-pondération du secteur lié aux gouvernements et en particulier des titres supranationaux a contribué à la performance, car le secteur a sous-performé le marché dans son ensemble sur la base d'un rendement excédentaire au cours de l'année.
- » Le positionnement en devises étrangères dans les marchés développés, et en particulier l'exposition longue modérée au yen japonais, a nui à la performance.
- » La sélection de titres dans le secteur bancaire a nui à la performance, dans un contexte de volatilité générale du secteur au début de l'année.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 18 février 2014) | 5,25 % | 2,22 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 5 octobre 2016) | 4,90 % | 2,53 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 18 février 2014) | 4,32 % | 1,30 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD) | 5,03 % | 2,19 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014) | 1,01 % | (0,02 %) |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en CHF) | 0,65 % | (0,12 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014) | 3,22 % | 0,57 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 janvier 2017) | 3,17 % | 0,82 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014) | 2,22 % | (0,34 %) |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en EUR) | 2,83 % | 0,53 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2017) | 4,59 % | 1,89 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 18 février 2014) | 4,64 % | 1,53 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en GBP) | 4,36 % | 1,49 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 22 septembre 2022) | 3,78 % | 3,44 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en SGD) | 3,54 % | 2,81 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Pour optimiser sa performance réelle, tout en protégeant son capital réel et en appliquant une gestion prudente des investissements, le Fonds Global Low Duration Real Return Fund investit au moins 70 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) indexés sur l'inflation et assortis d'échéances diverses, émis par des gouvernements, leurs agences ou organes et des entreprises. Les obligations indexées sur l'inflation sont des Instruments à revenu fixe structurés pour offrir une protection contre l'inflation. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux américains (MBS) a contribué à la performance relative, les écarts de ces titres s'étant resserrés.
- » Les stratégies de duration en Europe, y compris l'exposition courte au cours des trois premiers trimestres lorsque les rendements ont augmenté, et l'exposition aux écarts sur swaps de la zone euro au cours de la seconde moitié de la période lorsque les écarts se sont resserrés, ont contribué à la performance relative.
- » L'augmentation de la surpondération des taux d'intérêt américains à l'approche du pic du cycle a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt américains ayant considérablement baissé au dernier trimestre de l'année.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux allemands a nuí à la performance relative, car les rendements nominaux allemands ont baissé.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains japonais au cours de la première moitié de la période a nuí à la performance relative, en raison du coût de financement de la position et parce que l'anticipation d'une hausse de ces taux ne s'est pas matérialisée aussi rapidement que prévu.
- » La surpondération du yen japonais (JPY), en particulier en début de période, et la sous-pondération du dollar canadien (CAD), en particulier en fin de période, financées par la sous-pondération du dollar américain (USD), ont nuí à la performance relative, car le yen japonais s'est déprécié, tandis que le dollar canadien s'est apprécié par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|----------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 septembre 2003) | 4,86 % | 4,12 % |
| Institutions, distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 4,92 % | 3,77 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mars 2004) | 4,51 % | 3,60 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 24 février 2009) | 4,50 % | 4,02 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 17 décembre 2004) | 4,36 % | 3,34 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 3,89 % | 2,98 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005) | 3,93 % | 2,89 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 21 mai 2004) | 4,73 % | 3,92 % |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 4,64 % | 1,96 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD) | 4,52 % | 3,89 % ² |
| Catégories libellées en USD (exposition au risque de change) | | |
| Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 1 ^{er} septembre 2017) | 5,95 % | 0,51 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (non couvert en USD) | 5,47 % | 0,23 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 16 mai 2008) | 0,38 % | 1,80 % |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015) | 0,38 % | 0,14 % |
| Investisseurs en CHF (couverte), distribution (lancement le 24 février 2009) | 0,00 % | 2,20 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en CHF) | (0,18 %) | 1,47 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2003) | 2,54 % | 3,10 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 2,56 % | 2,66 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 7 avril 2004) | 2,24 % | 2,63 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 1,61 % | 1,90 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en EUR) | 2,02 % | 2,83 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 5 février 2004) | 4,08 % | 4,06 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 avril 2005) | 4,05 % | 3,63 % |
| Catégorie R en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 3,79 % | 1,28 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en GBP) | 3,52 % | 3,86 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 29 février 2008) | 3,29 % | 3,14 % |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en SGD) | 2,80 % | 2,98 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Global Real Return Fund a pour objectif d'optimiser la performance réelle, tout en préservant le capital réel et en appliquant une gestion prudente des investissements. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) indexés sur l'inflation, assortis d'échéances diverses et émis par des gouvernements, leurs agences ou organes et des entreprises. Le Fonds promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Les stratégies de duration en Europe, y compris l'exposition courte au cours des trois premiers trimestres lorsque les rendements ont augmenté, et l'exposition aux écarts sur swaps de la zone euro au cours de la seconde moitié de la période lorsque les écarts se sont resserrés, ont contribué à la performance relative.
- » L'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux américains (MBS) a contribué à la performance relative, les écarts de ces titres s'étant resserrés.
- » L'augmentation de l'exposition aux taux d'intérêt américains à l'approche du pic du cycle a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt américains ayant considérablement baissé au dernier trimestre de l'année.
- » La surpondération du point mort d'inflation japonais, sur fond de hausse de ce dernier, et le positionnement sur la courbe du point mort d'inflation britannique, ont contribué à la performance relative.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux allemands a nui à la performance relative, car les rendements nominaux allemands ont baissé.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains japonais au cours de la première moitié de la période a nui à la performance relative, en raison du coût de financement de la position et parce que l'anticipation d'une hausse de ces taux ne s'est pas matérialisée aussi rapidement que prévu.
- » La surpondération du yen japonais (JPY), en particulier en début de période, et la sous-pondération du dollar canadien (CAD), en particulier en fin de période, financées par la sous-pondération du dollar américain (USD), ont nui à la performance relative, car le yen japonais s'est déprécié, tandis que le dollar canadien s'est apprécié par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 8,61 % | 4,99 % |
| Institutions, distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 8,66 % | 5,00 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 20 janvier 2015) | 8,26 % | 3,75 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 18 avril 2013) | 8,30 % | 3,86 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 13 février 2017) | 8,08 % | 3,05 % |
| Administrations, distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 8,08 % | 4,48 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 7,62 % | 4,06 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 7,74 % | 4,06 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 25 mai 2018) | 8,41 % | 3,29 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018) | 8,44 % | 3,30 % |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 7 novembre 2019) | 8,34 % | 2,41 % |
| Catégorie R, distribution (lancement le 30 avril 2015) | 8,31 % | 3,66 % |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014) | 7,26 % | 2,64 % |
| Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014) | 7,17 % | 2,64 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 9,23 % | 5,56 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index | 5,53 % | 1,43 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 17 janvier 2018) | 6,61 % | 2,06 % |
| Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 7 septembre 2023) | — | 3,94 % |
| Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018) | 6,21 % | 2,03 % |
| Administrations en AUD (couverte), distribution (lancement le 8 juin 2016) | 6,11 % | 2,80 % |
| Catégorie E en AUD (couverte), distribution (lancement le 16 février 2017) | 5,59 % | 1,82 % |
| Catégorie Z en AUD (couverte), distribution II (lancement le 28 octobre 2015) | 7,17 % | 4,13 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD) | 3,53 % | 0,95 % ² |
| Catégories libellées en BRL | | |
| Institutions en BRL (couverte), capitalisation (lancement le 3 février 2016) | 25,09 % | 7,06 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en BRL) | 13,51 % | 7,65 % |
| Catégories libellées en CAD | | |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} avril 2016) | 7,67 % | 3,64 % |
| Institutions en CAD (couverte), distribution (lancement le 7 septembre 2018) | 7,77 % | 3,07 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CAD) | 4,61 % | 0,65 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 décembre 2014) | 3,97 % | 1,59 % |
| Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015) | 4,02 % | 1,37 % |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014) | 3,00 % | 0,94 % |
| Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 18 février 2014) | 3,08 % | 0,95 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF) | 0,82 % | (0,74 %) ² |
| Catégories libellées en CNH | | |
| Institutions en RMB (couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2023) | — | 1,94 % |
| Investisseurs en RMB (couverte), capitalisation (lancement le 3 janvier 2018) | 5,25 % | 3,31 % |
| Catégorie E en RMB (couverte), distribution (lancement le 22 mai 2013) | 4,68 % | 4,69 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CNH) | 2,45 % | 3,27 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 6,17 % | 3,38 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 6,14 % | 3,36 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 29 juillet 2014) | 6,08 % | 2,11 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2015) | 5,83 % | 1,54 % |

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Income Fund vise un revenu courant élevé, tout en appliquant une gestion prudente des investissements, avec pour objectif secondaire l'appréciation du capital à long terme. Le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses. Le Fonds vise à maintenir un niveau élevé de revenu des dividendes en investissant dans une large variété de secteurs à revenu fixe qui, selon le Conseiller en investissement, génèrent habituellement des revenus élevés.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux taux d'intérêt des liquidités aux États-Unis a contribué à la performance, car ils sont restés positifs.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprise à rendement élevé a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue à la durée américaine dans la partie intermédiaire de la courbe a contribué à la performance, car les taux d'intérêt américains sur cette partie de la courbe ont baissé.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis a pesé sur la performance, car les écarts se sont creusés.
- » L'exposition longue au yen japonais a nui à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.
- » L'exposition courte à la durée japonaise dans la partie intermédiaire de la courbe a nui à la performance, car les taux d'intérêt japonais sur cette partie de la courbe ont chuté.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹ (suite)

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|----------|---------------------------|
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mai 2015) | 5,83 % | 1,60 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), distribution A (lancement le 16 décembre 2015) | 5,84 % | 1,76 % |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 août 2015) | 5,59 % | 1,51 % |
| Administrations en EUR (couverte), distribution (lancement le 8 juin 2016) | 5,57 % | 1,31 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 5,15 % | 2,44 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 5,21 % | 2,45 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 31 août 2018) | 5,28 % | 0,53 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution II Q (lancement le 30 septembre 2019) | 5,18 % | (0,06 %) |
| G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 août 2017) | 5,29 % | 0,01 % |
| Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2016) | 5,86 % | 1,88 % |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 4,78 % | 0,78 % |
| Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014) | 4,75 % | 0,78 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR) | 3,01 % | (0,12 %) ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 7 février 2019) | 7,74 % | 2,23 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 février 2013) | 7,69 % | 3,52 % |
| Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2020) | 7,42 % | 1,00 % |
| Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 2 septembre 2016) | 7,19 % | 2,08 % |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 mars 2017) | 6,71 % | 1,38 % |
| Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 7,43 % | 3,96 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP) | 4,47 % | 0,80 % ² |
| Catégories libellées en HKD | | |
| Institutions en HKD (non couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015) | 8,67 % | 4,15 % |
| Investisseurs en HKD (non couverte), distribution (lancement le 31 octobre 2023) | — | 6,64 % |
| Administrations en HKD (non couverte), distribution (lancement le 26 avril 2017) | 8,06 % | 2,92 % |
| Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 4 février 2013) | 7,72 % | 3,45 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD) | 5,58 % | 1,59 % ² |
| Catégories libellées en JPY | | |
| Institutions en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 10 mars 2023) | — | 2,70 % |
| Investisseurs en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 2 juin 2023) | — | 2,10 % |
| Catégorie E en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} septembre 2017) | 1,56 % | (0,40 %) |
| Catégorie E en JPY (couverte), distribution (lancement le 21 décembre 2022) | 1,52 % | 0,69 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en JPY) | (0,86 %) | (1,82 %) ² |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 19 avril 2017) | 6,39 % | 2,12 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en NOK) | 3,44 % | 0,08 % |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 14 juillet 2020) | 6,89 % | 2,41 % |
| Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 16 décembre 2015) | 6,84 % | 3,77 % |
| Investisseurs en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 7 février 2020) | 6,61 % | 1,24 % |
| Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018) | 6,52 % | 2,52 % |
| Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012) | 6,42 % | 4,19 % |
| Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 19 février 2013) | 5,95 % | 3,09 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD) | 3,78 % | 1,21 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 29 janvier 2021) | 8,53 % | 0,61 % |
| Institutions, distribution (lancement le 3 mars 2023) | — | 7,55 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 29 janvier 2021) | 7,59 % | (0,27 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index | 5,53 % | (3,16 %) ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Catégorie E en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2021) | 5,60 % | (1,37 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD) | 3,53 % | (4,32 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 février 2021) | 5,03 % | (2,17 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR) | 3,01 % | (4,89 %) |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 17 février 2021) | 6,56 % | (0,96 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP) | 4,47 % | (3,77 %) |
| Catégories libellées en HKD | | |
| Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2021) | 7,47 % | (0,08 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD) | 5,58 % | (2,93 %) |
| Catégories libellées en JPY | | |
| Catégorie E en JPY (couverte), distribution (lancement le 15 novembre 2023) | — | 3,71 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en JPY) | — | 4,67 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Income Fund II vise un revenu courant élevé, tout en appliquant une gestion prudente des investissements, avec pour objectif secondaire l'appréciation du capital à long terme. Le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses. Le Fonds vise à maintenir un niveau élevé de dividendes en investissant dans une large variété de secteurs à revenu fixe qui, selon le Conseiller en investissement, génèrent habituellement des revenus élevés.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux taux d'intérêt des liquidités aux États-Unis a contribué à la performance, car ils sont restés positifs.
- » L'exposition longue à la duration américaine dans la partie intermédiaire de la courbe a contribué à la performance, car les taux d'intérêt américains sur cette partie de la courbe ont baissé.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprise à rendement élevé a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au crédit titrisé, à savoir aux titres adossés à des créances hypothécaires commerciales et résidentielles européens, a contribué à la performance, car les écarts sur ces titres se sont resserrés.
- » L'exposition courte à la duration japonaise dans la partie intermédiaire de la courbe a nui à la performance, car les taux d'intérêt japonais sur cette partie de la courbe ont chuté.
- » L'exposition longue aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis a pesé sur la performance, car les écarts se sont creusés.
- » L'exposition longue au yen japonais et au dollar australien a nui à la performance, car ces devises se sont dépréciées par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 14 février 2013) | 6,02 % | 1,53 % |
| Administrations, distribution II (lancement le 22 mars 2022) | 5,56 % | (2,35 %) |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 14 février 2013) | 5,05 % | 0,36 % |
| Catégorie E, distribution II (lancement le 2 août 2022) | 5,06 % | (0,61 %) |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022) | 5,82 % | 0,00 % |
| M Détail, distribution II (lancement le 2 août 2022) | 5,01 % | (0,66 %) |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en USD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en USD) ³ | 4,63 % | 1,34 % ² |
| Catégories libellées en AUD | | |
| Catégorie E en AUD (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 18 août 2022) | 3,53 % | (2,35 %) |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en AUD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en AUD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en AUD), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en AUD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en AUD) ³ | 2,87 % | (1,93 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2021) | 3,28 % | (1,19 %) |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2013) | 2,37 % | (0,48 %) |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte), distribution (lancement le 16 avril 2013) | 2,44 % | (0,47 %) |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en EUR), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en EUR), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en EUR), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en EUR), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en EUR) ³ | 1,69 % | 0,77 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 30 mai 2014) | 3,91 % | 1,88 % |
| Catégorie E en GBP (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2022) | 3,08 % | (2,13 %) |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en GBP), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en GBP), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en GBP), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en GBP), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en GBP) ³ | 2,20 % | 1,65 % ² |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Administrations en SGD (couverte), distribution II (lancement le 22 février 2022) | 3,81 % | (1,74 %) |
| Catégorie E en SGD (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2022) | 3,42 % | (2,27 %) |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en SGD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en SGD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en SGD), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en SGD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (couvert en SGD) ³ | 2,70 % | (2,83 %) ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Inflation Multi-Asset Fund est mesurée comme suit : du lancement au 31 mars 2017 : 45 % de l'Indice Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (partiellement couvert en USD), 30 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Total Return Index ; du 1^{er} avril 2017 au 12 avril 2022 : 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice Bloomberg Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (non couvert en USD), 10 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), 15 % de l'Indice Alerian MLP Total Return Index, 5 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return ; à partir du 13 avril 2022 : 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en USD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en USD).

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Inflation Multi-Asset Fund vise la préservation de la valeur réelle du capital par une gestion prudente des investissements. Le Fonds est géré activement et investit essentiellement dans un portefeuille diversifié d'actifs liés à l'inflation. Le Fonds vise à atteindre son objectif en investissant dans une combinaison d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) liés à l'inflation mondiale, d'obligations et de devises des marchés émergents, de titres de capital et titres liés et d'instruments liés aux matières premières et aux biens immobiliers. L'exposition à ces actifs peut être obtenue par un investissement direct ou par le recours à des instruments financiers dérivés tels que détaillés dans le Prospectus. Le Fonds poursuit une stratégie d'investissement axée sur plusieurs actifs, conformément à sa politique d'investissement. La stratégie a pour but de protéger le capital réel dans le temps au travers d'allocation à une gamme de catégories d'actifs liées à l'inflation. Dans le cadre de cette stratégie, le Conseiller en investissement recourt à des prévisions mondiales à long terme concernant les taux d'intérêt et l'inflation à travers plusieurs pays, combinées à un processus d'investissement intégré, tel que décrit dans le Prospectus.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

» Les stratégies actives de matières premières, y compris l'exposition aux California Carbon Allowances (CCA) et la sous-pondération du gaz naturel, ont contribué à la performance relative, car les CCA ont surperformé, tandis que le gaz naturel a sous-performé l'Indice Bloomberg Commodity Index général.

» Les stratégies de durée en Europe, y compris l'exposition courte au cours des trois premiers trimestres et l'exposition aux écarts sur swaps de la zone euro ont contribué à la performance relative, car les rendements ont augmenté et les écarts se sont resserrés.

» L'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux américains (MBS) a contribué à la performance relative, les écarts de ces titres s'étant resserrés.

» La surpondération du point mort d'inflation japonais a contribué à la performance relative, ce dernier ayant progressé.

» L'allocation tactique sous-pondérée à l'or a nuï à la performance relative, car le prix de l'or a augmenté au cours de la période.

» La sous-pondération des taux d'intérêt souverains japonais au cours de la première moitié de la période a nuï à la performance relative, en raison du coût de financement de la position et parce que l'anticipation d'une hausse de ces taux ne s'est pas matérialisée aussi rapidement que prévu.

» La surpondération du yen japonais (JPY), en particulier au cours de la première moitié de la période, et la sous-pondération du dollar canadien (CAD), en particulier en fin de période, financées par la sous-pondération du dollar américain (USD), ont nuï à la performance relative, car le yen japonais s'est déprécié, tandis que le dollar canadien s'est apprécié par rapport au dollar américain.

» La sélection de titres dans le secteur des actions immobilières des marchés développés a nuï à la performance relative.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 5 décembre 2002) | 5,00 % | 2,37 % |
| Institutions, distribution (lancement le 5 décembre 2002) | 5,00 % | 2,36 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 13 mai 2004) | 4,65 % | 2,06 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 3 juillet 2003) | 4,67 % | 1,95 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 8 septembre 2004) | 4,49 % | 1,87 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 septembre 2007) | 4,06 % | 1,27 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005) | 4,02 % | 1,54 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 4 novembre 2009) | 4,78 % | 1,46 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 12 décembre 2018) | 4,82 % | 1,19 % |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 4,69 % | 0,81 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index | 4,26 % | 1,84 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 janvier 2012) | 2,88 % | (0,01 %) |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 2,80 % | 1,42 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 24 juillet 2009) | 1,91 % | (0,21 %) |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (couvert en EUR) | 2,08 % | 0,82 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2017) | 4,31 % | 0,24 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} mars 2010) | 4,30 % | 1,13 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (couvert en GBP) | 3,60 % | 0,64 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Low Average Duration Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Les stratégies de duration aux États-Unis, en particulier la surpondération de la partie de un à cinq ans de la courbe au cours du second semestre 2023, ont contribué à la performance relative, les taux d'intérêt ayant chuté.
- » La surpondération des prêts garantis a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » Les positions détenues sur le segment du crédit d'entreprises de qualité « investment grade », en particulier dans le secteur de la finance, ont contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » Les participations dans le crédit extérieur des marchés émergents, en particulier en Amérique latine et centrale, ont contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition courte à la duration du Japon, en particulier à la partie à long terme de la courbe, a nuí à la performance relative du fait de la chute des taux.
- » Un biais long sur le yen japonais par rapport au dollar américain a nuí à la performance relative, le yen japonais s'étant déprécié.
- » La sous-pondération des indices de swaps de défaillance des entreprises à rendement élevé a nuí à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 février 2014) | 7,16 % | 2,10 % |
| Institutions, distribution (lancement le 22 juin 2021) | 7,16 % | 0,05 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD) | 6,83 % | 2,10 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014) | 4,91 % | 0,46 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 3 juin 2021) | 5,01 % | (1,75 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014) | 4,02 % | (0,45 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en EUR) | 4,59 % | 0,43 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014) | 6,50 % | 1,40 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 3 juin 2021) | 6,47 % | (0,53 %) |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en GBP) | 6,10 % | 1,39 % ² |
| Catégories libellées en NOK | | |
| Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 10 juillet 2017) | 5,39 % | 0,91 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en NOK) | 5,08 % | 1,11 % |
| Catégories libellées en SEK | | |
| Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 25 août 2023) | — | 3,78 % |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en SEK) | — | 3,46 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund vise à optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) d'entreprises de qualité « investment grade ».

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sélection de titres dans le secteur bancaire a contribué à la performance, car la surpondération de la dette senior d'une banque suisse a surperformé suite à son acquisition par un concurrent mieux noté.
- » La sous-pondération des titres d'entités liées à un gouvernement a contribué à la performance, en raison de la sous-performance du secteur.
- » La sélection de titres dans le secteur des sociétés financières a contribué à la performance, l'exposition à un émetteur ayant surperformé le marché dans son ensemble.
- » Les stratégies de duration, et en particulier le positionnement sur la courbe dans le segment de la duration des États-Unis, ont nui à la performance.
- » Les stratégies de change, et en particulier l'exposition courte à l'euro au quatrième trimestre, ont nui à la performance, l'euro s'étant apprécié par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 mai 2018) | 8,26 % | 2,99 % |
| Institutions, distribution (lancement le 31 mai 2018) | 8,14 % | 2,99 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mai 2018) | 7,25 % | 2,11 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 14 septembre 2018) | 7,14 % | 2,11 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 3 septembre 2020) | 8,01 % | 2,68 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 18 janvier 2022) | 7,99 % | 2,14 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index | 4,65 % | 1,58 % ² |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 20 octobre 2023) | — | 4,00 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en CHF) | — | 1,64 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018) | 5,94 % | 0,91 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 22 novembre 2021) | 5,97 % | 0,19 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018) | 5,03 % | 0,04 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2018) | 4,96 % | 0,03 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en EUR) | 2,51 % | (0,40 %) ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018) | 7,52 % | 1,97 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2018) | 7,43 % | 1,94 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en GBP) | 4,01 % | 0,72 % |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2020) | 6,62 % | 2,39 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en SGD) | 3,20 % | (0,29 %) |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Low Duration Income Fund vise des revenus attrayants, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. L'appréciation du capital à long terme est un objectif secondaire. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux taux d'intérêt des liquidités aux États-Unis a contribué à la performance, car ils sont restés positifs.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprise à rendement élevé a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au crédit titrisé, notamment aux titres adossés à des créances hypothécaires commerciales et résidentielles européens, a contribué à la performance, car les écarts sur ces titres se sont resserrés.
- » L'exposition longue aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis a pesé sur la performance, car les écarts sur ces titres se sont creusés.
- » L'exposition courte à la duration japonaise dans la partie intermédiaire de la courbe a nui à la performance, car les taux d'intérêt japonais sur cette partie de la courbe ont chuté.
- » L'exposition longue au yen japonais a nui à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 29 janvier 2016) | 7,03 % | 2,03 % |
| Institutions, distribution (lancement le 7 mars 2019) | 6,95 % | 1,31 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 septembre 2021) | 7,58 % | (0,26 %) |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³ | 5,20 % | 1,68 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016) | 4,91 % | 0,06 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 4 avril 2018) | 4,86 % | (0,43 %) |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 janvier 2018) | 4,40 % | (0,88 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 octobre 2017) | 4,06 % | (1,30 %) |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁴ | 3,29 % | 0,09 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016) | 6,34 % | 1,11 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2019) | 6,25 % | 0,61 % |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁵ | 4,78 % | 1,06 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Low Duration Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

⁴ La performance de l'indice de référence du Fonds Low Duration Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

⁵ La performance de l'indice de référence du Fonds Low Duration Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice LIBOR GBP à 1 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2021 : Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Low Duration Opportunities Fund vise à optimiser la performance à long terme, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses. Le Fonds cherchera à atteindre des rendements supérieurs à ceux de l'Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (une mesure du rendement des titres du marché monétaire) sur le moyen à long terme, en investissant de manière souple dans divers Instruments à revenu fixe suivant les opinions du Conseiller en investissement sur les titres à revenu fixe mondiaux.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux taux d'intérêt des liquidités aux États-Unis a contribué à la performance, car ils sont restés positifs.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue à la duration américaine dans les parties à court terme et intermédiaire de la courbe a contribué à la performance, car les taux d'intérêt américains sur ces parties de la courbe ont baissé.
- » L'exposition longue aux prêts garantis (« CLO ») notés AAA a contribué à la performance, car les écarts sur ces titres se sont resserrés.
- » L'exposition courte au zloty polonais a nui à la performance, car la devise s'est appréciée par rapport au dollar américain.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprises à rendement élevé a nui à la performance, ces titres ayant dégagé une performance négative en raison de leur sélection.
- » L'exposition courte à la duration polonaise a nui à la performance, car les taux d'intérêt polonais ont chuté.
- » L'exposition courte à l'euro a nui à la performance, car la devise s'est appréciée par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 5,56 % | 3,13 % |
| Institutions, distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 5,43 % | 3,09 % |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index | 5,20 % | 4,59 % |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 3,37 % | 0,77 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 3,26 % | 0,72 % |
| Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index | 3,31 % | 2,54 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022) | 4,87 % | 2,30 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022) | 4,92 % | 2,30 % |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index | 4,78 % | 4,05 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund vise à optimiser la performance à long terme, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit dans des circonstances normales au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe d'échéances diverses. La duration moyenne de portefeuille de ce Fonds variera normalement de moins 1 an à plus 5 ans en fonction des prévisions en matière de taux d'intérêt du Conseiller en investissement. Le Fonds cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales de diverses manières dans des conditions de marché normales, comme indiqué dans le Supplément du Fonds, et cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux taux d'intérêt des liquidités aux États-Unis a contribué à la performance, car ils sont restés positifs.
- » L'exposition longue au crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue à la duration australienne a contribué à la performance, car les taux d'intérêt australiens ont chuté.
- » L'exposition tactique à la duration américaine a nui à la performance, étant donné que les niveaux de portage des obligations à moyen terme étaient inférieurs au portage des taux des liquidités.
- » L'exposition courte à l'euro a nui à la performance, car l'euro s'est apprécié par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 25 novembre 2014) | 14,26 % | 1,66 % |
| Institutions, distribution (lancement le 25 novembre 2014) | 14,38 % | 1,67 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 25 novembre 2014) | 13,21 % | 0,50 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 7 juin 2019) | 15,45 % | 9,08 % |
| Indice Alerian MLP Index | 26,56 % | 0,43 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 novembre 2014) | 11,79 % | (0,37 %) |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 novembre 2014) | 11,88 % | (0,34 %) |
| Indice Alerian MLP Index en EUR (couvert) | 23,64 % | (1,32 %) |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 novembre 2014) | 13,47 % | (0,07 %) |
| Indice Alerian MLP Index en GBP (couvert) | 25,34 % | (1,13 %) |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. La « performance totale » recherchée par le Fonds se compose du revenu et de l'appréciation du capital. Le Fonds cherche à atteindre cet objectif d'investissement en investissant, dans des conditions normales, au moins les deux tiers de ses actifs nets directement ou indirectement dans un portefeuille d'investissements en actions qui sont liées (i) à des sociétés de personnes cotées en bourse, qui sont également connues en tant que sociétés en commandite principales, (ii) aux associés commandités qui sont propriétaires des sociétés en commandite principales ou les gèrent, (iii) aux entreprises issues d'une scission partielle (sociétés qui se sont séparées des sociétés en commandites principales ou des associés commandités après restructuration ou dessaisissement), (iv) des sociétés qui sont similaires aux sociétés en commandite principales du fait qu'elles opèrent dans le même secteur ou sont en concurrence, (v) d'autres entités qui peuvent ne pas être structurées en tant que sociétés de personnes cotées en bourse mais qui opèrent dans le secteur intermédiaire de l'énergie (la composante transports du secteur de l'énergie tels que les pipelines, le chemin de fer et les pétroliers) et (vi) des entités ad-hoc (c'est-à-dire des entités établies dans un objectif précis qui peuvent être utilisées comme structure de placement pour accéder à des investissements décrits ici). Le Fonds peut investir dans ces instruments soit sur le marché secondaire ou au cours d'une introduction en bourse.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sélection de titres dans le sous-secteur de la collecte et du traitement a contribué à la performance relative, car les participations détenues par le Fonds dans ce secteur ont surperformé.
- » La sélection de titres au sein des sociétés de liquéfaction a contribué à la performance relative, car les participations détenues par le Fonds dans ce secteur ont surperformé.
- » La sélection de titres dans le sous-secteur du transport par pipeline du pétrole a nui à la performance relative, car les participations du Fonds dans ce secteur ont sous-performé.
- » La sélection de titres dans le sous-secteur du transport par pipeline du gaz naturel a nui à la performance relative, car les participations du Fonds dans ce secteur ont sous-performé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 25 janvier 2017) | 6,98 % | 2,02 % |
| Institutions, distribution (lancement le 25 janvier 2017) | 7,06 % | 2,04 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 12 mai 2017) | 6,60 % | 1,42 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 25 janvier 2017) | 6,57 % | 1,67 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 janvier 2017) | 5,99 % | 1,12 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 25 janvier 2017) | 6,03 % | 1,11 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 14 mai 2020) | 6,77 % | 1,51 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 2 octobre 2023) | — | 4,00 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 3 septembre 2019) | 7,77 % | 4,01 % |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³ | 5,20 % | 2,00 % ² |
| Catégories libellées en CAD | | |
| Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} juin 2021) | 6,37 % | (0,58 %) |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en CAD) ³ | 4,64 % | 2,36 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017) | 2,68 % | (0,60 %) |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en CHF) ³ | 0,95 % | (0,64 %) |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017) | 4,82 % | 0,01 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 janvier 2017) | 4,76 % | 0,01 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017) | 3,87 % | (0,89 %) |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en EUR) ³ | 3,11 % | 0,01 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017) | 6,32 % | 1,06 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 25 janvier 2017) | 6,49 % | 1,08 % |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en GBP) ³ | 4,62 % | 1,08 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Mortgage Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 3 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Mortgage Opportunities Fund vise à optimiser la performance à long terme tout en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant dans des circonstances normales au moins 80 % de son actif net dans un portefeuille diversifié composé d'Instruments à revenu fixe liés à des créances hypothécaires (tels que définis dans le Prospectus), notamment des titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles et commerciales émis ou non par des organismes gouvernementaux et des titres assurant un transfert du risque de crédit.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition positive à la durée, en particulier à la partie intermédiaire de la courbe des taux américains, a contribué à la performance, les taux ayant diminué.
- » L'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles senior non émis par des organismes gouvernementaux (RMBS) a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition aux titres senior adossés à des actifs (ABS) a contribué à la performance, car la catégorie d'actifs a dégagé une performance positive.
- » Les stratégies de valeur relative en titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux ont nui à la performance, car les écarts se sont légèrement creusés.
- » L'exposition à un titre adossé à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) non émis par des organismes gouvernementaux a nui à la performance, car ce titre a sous-performé.
- » Il n'y a pas eu d'autres facteurs négatifs importants pour ce Fonds.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 décembre 1998) | 26,24 % | 7,37 % |
| Institutions, distribution (lancement le 22 novembre 2001) | 26,24 % | 8,59 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 7 janvier 1999) | 25,80 % | 6,87 % |
| BE Détail, capitalisation (lancement le 28 avril 2022) | 23,79 % | 4,23 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006) | 25,11 % | 8,78 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 8 janvier 2020) | 25,98 % | 10,24 % |
| Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes) | 25,67 % | 6,96 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2012) | 23,21 % | 11,11 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2017) | 22,10 % | 8,03 % |
| Indice S&P 500 Index (couvert en EUR) (net de la retenue à la source sur les dividendes) | 22,19 % | 10,75 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds StocksPLUS™ Fund vise une performance supérieure à la performance de rendement total de l'Indice Standard & Poor's 500 Composite Stock Price Index (« S&P 500 ») en ayant recours à une stratégie interne de gestion de portefeuille, qui associe un portefeuille activement géré de Titres à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) à une exposition à l'Indice S&P 500 Index. Le Fonds peut investir sans limites dans des titres de capital et des titres convertibles en titres de capital.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition du Fonds aux produits dérivés sur indices boursiers liés à l'Indice S&P 500 Index a contribué à la performance absolue, l'Indice S&P 500 Net Total Return Index ayant enregistré un rendement de 25,67 %.
- » La stratégie alpha obligataire du Fonds a contribué à la performance. Les principaux facteurs ayant eu un impact positif sur la performance comprennent les points ci-dessous :
 - » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
 - » Les participations dans des titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux ont contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
 - » L'exposition longue aux taux d'intérêt américains a nui à la performance, car l'exposition du Fonds était élevée au premier semestre, lorsque les taux d'intérêt ont augmenté.
 - » L'exposition courte au crédit d'entreprises à rendement élevé a nui à la performance, car les écarts se sont resserrés.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 29 mars 2019) | 27,08 % | 12,99 % |
| Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes) | 25,67 % | 12,89 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund vise à optimiser sa performance totale tout en appliquant une gestion prudente des investissements, en ayant recours à la stratégie exclusive de gestion de portefeuille du Conseiller en investissement connue sous le nom de « StocksPLUS » (qui combine un portefeuille activement géré d'instruments à revenu fixe avec une exposition aux titres de capital). Les instruments à revenu fixe sont similaires à des prêts et versent un taux d'intérêt fixe ou variable.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition du Fonds aux produits dérivés sur indices boursiers liés à l'Indice S&P 500 Index a contribué à la performance absolue, l'Indice S&P 500 Net Total Return Index ayant enregistré un rendement de 25,67 %.
- » La stratégie alpha obligataire du Fonds a contribué à la performance. Les principaux facteurs ayant eu un impact positif sur la performance comprennent les points ci-dessous :
 - » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
 - » Les participations dans des prêts garantis ont contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
 - » L'exposition longue aux taux d'intérêt américains a nui à la performance, pendant les périodes de hausse des taux d'intérêt.
 - » L'exposition longue aux taux d'intérêt brésiliens a nui à la performance, car l'exposition du Fonds était élevée lorsque les taux d'intérêt ont augmenté.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 14 mars 2018) | 9,88 % | 3,69 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 16 décembre 2013) | 8,88 % | 3,75 % |
| Catégorie E, distribution II (lancement le 16 décembre 2013) | 8,91 % | 3,75 % |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index et 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index ³ | 6,53 % | 3,77 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 décembre 2013) | 7,34 % | 3,21 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 décembre 2013) | 6,46 % | 2,27 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 16 décembre 2013) | 6,43 % | 2,27 % |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 5,99 % | 1,17 % |
| Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014) | 6,04 % | 1,18 % |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en EUR) et 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en EUR) ³ | 3,92 % | 2,35 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 juillet 2022) | 8,91 % | 5,38 % |
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en GBP) et 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en GBP) ³ | 5,40 % | 0,48 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds Strategic Income Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 26 juillet 2016 : 75 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate Index couvert en USD/25 % de l'Indice MSCI All Country World Index ; du 27 juillet 2016 au 28 juillet 2022 : 75 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en USD/25 % de l'Indice MSCI World Index ; à partir du 29 juillet 2022 : 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Strategic Income Fund vise un niveau attrayant de revenu courant en appliquant une gestion prudente des investissements, l'appréciation du capital à long terme constituant un objectif secondaire. Le Fonds applique une stratégie multisectorielle mondiale visant à combiner le processus d'investissement et la philosophie de rendement total du Conseiller en investissement à la maximisation du revenu. La construction du portefeuille se fonde sur le principe de diversification dans un large éventail de titres à revenu fixe et de titres de capital mondiaux.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » L'exposition aux taux d'intérêt des liquidités aux États-Unis a contribué à la performance, car ils sont restés positifs.
- » L'exposition longue à la durée américaine dans la partie intermédiaire de la courbe a contribué à la performance, car les taux d'intérêt américains sur cette partie de la courbe ont baissé.
- » L'exposition longue à un panier sélectionné de devises des marchés émergents a contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées face au dollar américain.
- » L'exposition longue aux actions américaines a contribué à la performance, car elles ont dégagé des rendements positifs au cours de la période.
- » Les positions sur le crédit d'entreprises à rendement élevé ont contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au yen japonais a nuí à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.
- » Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux ont nuí à la performance, ces titres s'étant dépréciés.
- » L'exposition courte à la durée japonaise dans la partie intermédiaire de la courbe a nuí à la performance, car les taux d'intérêt japonais sur cette partie de la courbe ont chuté.
- » L'exposition longue au peso argentin a nuí à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 1998) | 6,27 % | 4,42 % |
| Institutions, distribution (lancement le 25 avril 2000) | 6,29 % | 4,40 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 janvier 1999) | 5,92 % | 3,87 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 23 octobre 2000) | 5,94 % | 3,84 % |
| Administrations, capitalisation (lancement le 16 mai 2003) | 5,77 % | 2,99 % |
| Administrations, distribution (lancement le 21 juillet 2022) | 5,74 % | 1,03 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 5,36 % | 2,74 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 10 octobre 2005) | 5,35 % | 2,65 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002) | 6,11 % | 3,61 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018) | 6,15 % | 1,04 % |
| Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014) | 5,01 % | 0,29 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index | 5,53 % | 3,99 % ² |
| Catégories libellées en CAD | | |
| Institutions en CAD (couverte), distribution (lancement le 2 mai 2013) | 5,37 % | 1,12 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CAD) | 4,61 % | 1,24 % |
| Catégories libellées en CHF | | |
| Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011) | 1,74 % | (0,03 %) |
| Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011) | 1,28 % | (0,38 %) |
| Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 19 septembre 2012) | 0,84 % | (1,52 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF) | 0,82 % | (0,07 %) ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2003) | 3,82 % | 2,56 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 3,78 % | 2,48 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2004) | 3,47 % | 2,08 % |
| Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2009) | 3,32 % | 0,80 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 2,88 % | 1,66 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mars 2012) | 2,81 % | (0,58 %) |
| Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 3,47 % | (0,42 %) |
| Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014) | 2,58 % | (1,42 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR) | 3,01 % | 2,12 % ² |
| Catégories libellées en EUR (non couvertes) | | |
| Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 13 juin 2002) | 2,66 % | 3,04 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en EUR) | 1,96 % | 2,69 % |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 26 mars 2010) | 5,39 % | 1,87 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 5,35 % | 3,32 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP) | 4,47 % | 2,91 % ² |
| Catégories libellées en HKD | | |
| M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 20 février 2013) | 5,43 % | 0,59 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD) | 5,58 % | 1,60 % |
| Catégories libellées en SGD | | |
| Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 11 janvier 2011) | 4,60 % | 1,88 % |
| Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 février 2023) | — | 3,14 % |
| Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 15 février 2007) | 3,64 % | 2,17 % |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD) | 3,78 % | 2,68 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds Total Return Bond Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Pour atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La position tactique sur la courbe de la durée américaine, notamment la surpondération de la partie intermédiaire de la courbe et la sous-pondération de la partie à long terme de la courbe, a contribué à la performance relative, les rendements américains ayant augmenté.
- » Les positions sur le crédit titrisé, en particulier les prêts garantis et les titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux, ont contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » La sélection au sein du crédit d'entreprises de qualité « investment grade », en particulier au sein des titres financiers senior, a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » La surpondération des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés au quatrième trimestre.
- » La sous-pondération du crédit d'entreprises à rendement élevé a nui à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition courte à la durée au Japon a nui à la performance relative, les rendements japonais ayant chuté aux premier, deuxième et quatrième trimestres.
- » L'exposition modeste au yen japonais a nui à la performance relative, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|----------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2015) | (3,52 %) | 2,49 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 23 septembre 2022) | (3,92 %) | (7,47 %) |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 juin 2015) | (4,58 %) | 1,38 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022) | (3,65 %) | (1,78 %) |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 décembre 2021) | (2,15 %) | 4,49 % |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³ | 5,20 % | 1,74 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2015) | (5,14 %) | 0,81 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2022) | (5,54 %) | (9,00 %) |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2015) | (6,25 %) | (0,30 %) |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en EUR) ³ | 3,11 % | 0,04 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2022) | (3,74 %) | (4,40 %) |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 23 septembre 2022) | (3,75 %) | (7,42 %) |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en GBP) ³ | 4,62 % | 4,16 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'Indice de référence du Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 3 mois ; à partir du 1^{er} juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds PIMCO TRENDS Managed Future Strategy Fund vise un rendement positif, ajusté du risque, tout en appliquant une gestion prudente des investissements, en investissant dans des circonstances normales dans des produits dérivés de taux d'intérêt, de devises, de titres liés à des créances hypothécaires (comme décrit dans le Prospectus du Fonds), des instruments de crédit, d'indices d'actions et des instruments liés à la volatilité (y compris, sans s'y limiter, des contrats à terme standardisés sur indices liés à la volatilité) et des instruments liés aux matières premières (comme décrit dans le Prospectus du Fonds).

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » Les positions sur un large éventail de marchés de taux mondiaux ont généré des pertes en raison de plusieurs retournements brutaux tout au long de l'année. Les positions courtes sur les taux chiliens et sud-africains, ainsi que les positions longues sur les taux hongrois, ont fortement pesé sur la performance.
- » Les positions courtes sur le baht thaïlandais, le dollar néo-zélandais et la roupie indienne par rapport au dollar américain ont nui à la performance, en raison de retournements des cours.
- » Les positions sur les actions de la zone Asie-Pacifique ont généré des pertes en raison de plusieurs retournements brutaux tout au long de l'année. Les positions sur les indices de Singapour, de la Chine et de la Corée ont fortement pesé sur la performance.
- » Les positions longues sur le peso mexicain et le peso colombien, qui se sont tous deux appréciés par rapport au dollar américain, et les positions courtes sur le renminbi chinois, qui s'est déprécié par rapport au dollar américain, ont contribué à la performance.
- » Les positions courtes sur le gaz naturel ont contribué à la performance en raison de la baisse des prix de l'énergie.
- » Les positions courtes sur la volatilité implicite des actions américaines et européennes ont contribué à la performance en raison de la faiblesse persistante de la volatilité.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| Catégories libellées en GBP | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 septembre 2007) | 8,52 % | 4,31 % |
| Institutions, distribution (lancement le 8 juillet 2016) | 8,55 % | 0,79 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 20 novembre 2019) | 9,02 % | (1,72 %) |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index | 8,62 % | 4,08 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds UK Corporate Bond Fund vise à optimiser la performance totale, tout en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) libellés en livre sterling et assortis d'échéances diverses, qui peuvent être représentés par des participations directes dans des Titres à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) ou des instruments dérivés tels que, notamment, des options, des contrats à terme standardisés, des swaps ou des swaps de défaillance.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sous-pondération des émetteurs souverains, et en particulier des titres supranationaux, a contribué à la performance, le secteur ayant sous-performé.
- » La sélection de titres dans le secteur de la vente au détail a contribué à la performance, car l'exposition à certains émetteurs a surperformé.
- » La sélection de titres dans le secteur immobilier a contribué à la performance, car certains émetteurs surpondérés ont surperformé.
- » Les stratégies macro, et en particulier le positionnement sur les taux d'intérêt en livre sterling, ont nui à la performance.
- » La sélection de titres dans le secteur bancaire et du courtage a nui à la performance, car la dette subordonnée d'un émetteur auquel le Fonds est exposé a sous-performé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| Catégories libellées en GBP | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005) | 9,57 % | 4,23 % |
| Institutions, distribution (lancement le 14 août 2008) | 9,55 % | 5,21 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index ³ | 10,57 % | 3,86 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 mars 2013 : Indice Markit iBoxx Sterling Non-Gilts 10+ Index ; à partir du 31 mars 2013 : Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund vise l'optimisation de la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Le Fonds investit au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) de catégorie « investment grade » libellés en livre sterling et assortis d'échéances diverses.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sélection de titres au sein des produits titrisés a contribué à la performance, en raison de l'exposition à certains émetteurs ayant surperformé et de la sous-performance d'autres émetteurs auxquels le Fonds n'était pas exposé.
- » La sélection de titres dans le secteur de la vente au détail a contribué à la performance, car l'exposition à certains émetteurs a surperformé.
- » La sélection de titres dans le secteur bancaire et du courtage a nui à la performance, car l'exposition à la dette subordonnée d'un émetteur a sous-performé.
- » Les stratégies macro-économiques ont nui à la performance en raison du positionnement sur les taux d'intérêt en livre sterling.
- » La sélection de titres au sein du secteur des services aux collectivités a nui à la performance, un émetteur sous-pondéré particulier ayant surperformé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|---------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 28 mai 1998) | 12,88 % | 5,61 % |
| Institutions, distribution (lancement le 23 janvier 2001) | 12,83 % | 5,93 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 mars 1999) | 12,48 % | 5,26 % |
| Investisseurs, distribution (lancement le 14 janvier 1999) | 12,49 % | 5,24 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 11,84 % | 4,42 % |
| Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006) | 11,89 % | 4,50 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002) | 12,68 % | 6,63 % |
| H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020) | 12,72 % | 1,82 % |
| M Détail, distribution (lancement le 11 janvier 2012) | 11,90 % | 4,23 % |
| Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012) | 12,64 % | 4,30 % |
| Catégorie Z, capitalisation (lancement le 29 juin 2016) | 13,48 % | 5,22 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index ³ | 13,47 % | 5,83 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2003) | 10,34 % | 4,95 % |
| Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005) | 10,37 % | 4,23 % |
| Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 février 2003) | 9,96 % | 4,86 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006) | 9,34 % | 3,24 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (couvert en EUR) ³ | 10,77 % | 5,62 % ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2003) | 11,91 % | 5,58 % |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 juin 2016) | 11,96 % | 3,32 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (couvert en GBP) ³ | 12,35 % | 6,07 % ² |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

³ La performance de l'indice de référence du Fonds US High Yield Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 31 mars 2015 : Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield BB-B Rated Constrained Index ; à partir du 1^{er} avril 2015 : Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds US High Yield Bond Fund a pour objectif d'optimiser la performance totale, tout en préservant le capital et en appliquant une gestion prudente des investissements. Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds investit au moins les deux tiers de son actif net total dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) à rendement élevé notés en dessous de Baa par Moody's ou de BBB par S&P ou ayant reçu une note équivalente attribuée par Fitch.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La surpondération et la sélection de titres dans le secteur des matériaux de construction ont contribué à la performance, car le secteur a surperformé le marché dans son ensemble au cours de la période.
- » La sous-pondération du secteur des télécommunications filaires a contribué à la performance, car le secteur a sous-performé le marché dans son ensemble.
- » La sélection de titres au sein du secteur des services aux consommateurs a contribué à la performance, de par l'exposition nulle à certains émetteurs qui ont sous-performé.
- » La sélection de titres dans le secteur de la vente au détail a nui à la performance, l'exposition à un émetteur ayant sous-performé.
- » La sélection de titres dans le secteur des médias, du divertissement et de l'édition a nui à la performance, car un émetteur surpondéré a sous-performé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|--|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 15 septembre 2016) | 8,82 % | 1,91 % |
| Institutions, distribution (lancement le 15 septembre 2016) | 8,85 % | 1,91 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 7 novembre 2019) | 7,80 % | (1,48 %) |
| Catégorie E, distribution (lancement le 8 mars 2019) | 7,81 % | 0,45 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022) | 8,64 % | 4,10 % |
| Indice Bloomberg U.S. Credit Index | 8,18 % | 1,92 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2016) | 6,29 % | (0,28 %) |
| Indice Bloomberg U.S. Credit Index (couvert en EUR) | 5,50 % | (0,30 %) |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), distribution II (lancement le 15 septembre 2016) | 7,85 % | 0,71 % |
| Indice Bloomberg U.S. Credit Index (couvert en GBP) | 6,99 % | 0,74 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund cherche à optimiser la performance totale, tout en appliquant une préservation du capital et une gestion prudente des investissements en investissant au moins deux tiers de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) d'entreprises de qualité « investment grade », libellés en dollar américain et assortis d'échéances diverses, qui peuvent être représentés par des positions sur des Titres à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) liés à des crédits ou des instruments dérivés tels que des options, des contrats à terme standardisés ou des swaps de défaillance, tel qu'indiqué plus en détail dans le Prospectus.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sélection de titres dans le secteur bancaire a contribué à la performance, car la surpondération de la dette senior d'une banque suisse a surperformé suite à son acquisition par un concurrent mieux noté.
- » La sélection de titres au sein du secteur des services aux collectivités a contribué à la performance, car un émetteur surpondéré a surperformé.
- » La sous-pondération des titres d'entités liées à un gouvernement a contribué à la performance, en raison de la sous-performance du secteur.
- » L'exposition au crédit titrisé a nuï à la performance, les créances hypothécaires émises par des organismes gouvernementaux et certaines créances hypothécaires non émises par des organismes gouvernementaux ayant sous-performé.
- » La sous-pondération du secteur des technologies a nuï à la performance, ce secteur ayant surperformé.

Rendement total annuel moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023¹

| | 1 an | Lancement de la catégorie |
|---|--------|---------------------------|
| Catégories libellées en USD | | |
| Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2014) | 5,81 % | 1,95 % |
| Institutions, distribution (lancement le 11 mai 2020) | 5,87 % | 2,10 % |
| Investisseurs, capitalisation (lancement le 30 juin 2014) | 5,44 % | 1,60 % |
| Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 juin 2014) | 5,46 % | 1,56 % |
| H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018) | 5,66 % | 1,92 % |
| Catégorie Z, distribution (lancement le 7 août 2014) | 6,34 % | 2,44 % |
| Indice FTSE 3-Month Treasury Bill Index | 5,26 % | 1,32 % ² |
| Catégories libellées en EUR | | |
| Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016) | 3,83 % | 0,36 % |
| Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 juin 2016) | 3,46 % | (0,16 %) |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (couvert en EUR) | 2,93 % | (0,34 %) ² |
| Catégories libellées en GBP | | |
| Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2023) | — | 3,48 % |
| Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (couvert en GBP) | — | 2,96 % |

¹ Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.

² La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

Le Fonds US Short-Term Fund vise à optimiser les revenus courants tout en préservant le capital et la liquidité journalière. Le Fonds investit au moins deux tiers de son actif total dans un portefeuille diversifié d'Instruments à revenu fixe (tels que définis dans le Prospectus) assortis d'échéances diverses émis par diverses entités américaines et autres du secteur privé ou public. La durée moyenne du portefeuille de ce Fonds varie normalement en fonction des prévisions du Conseiller en investissement en matière de taux d'intérêt et ne devrait pas être supérieure à un an. Le Fonds utilisera l'Indice FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index comme indice de référence de la performance. L'indice FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index est un indice non géré qui représente les rendements mensuels équivalents aux moyennes de rendement des émissions de bons du Trésor sur les trois derniers mois.

Aperçu du Fonds

Les éléments suivants ont affecté la performance (sur une base brute) de la période comptable :

- » La sous-pondération de la durée américaine, car l'inversion de la courbe des taux américains a offert un avantage en termes de portage par rapport à l'indice de référence sur fond de hausse des taux américains à court terme.
- » Les positions détenues sur le segment du crédit d'entreprises de qualité « investment grade », en particulier dans le secteur de la finance, ont contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » La surpondération des prêts garantis a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » La surpondération des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux a nuí à la performance relative (principalement aux premier et deuxième trimestres), les écarts s'étant creusés au cours de cette période.
- » Il n'y a pas eu d'autres facteurs négatifs importants pour ce Fonds.

Description des indices de référence

| Nom officiel des indices de référence | Description des indices |
|--|--|
| Indice NIBOR Rate Index à 1 mois | Le NIBOR (Norwegian Interbank Offered Rate) à 1 mois est un taux d'intérêt moyen, fixé par Norges Bank, dérivé du taux d'un prêt similaire sur le marché en dollar américain, majoré du différentiel de taux d'intérêt entre la couronne norvégienne et le dollar américain obtenu sur le marché des changes à terme. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index, JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified ; tous couverts en USD. | L'Indice Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index fournit une mesure large des marchés à revenu fixe de qualité « investment grade » des pays développés du monde entier. L'Indice ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index réplique la performance des obligations de qualité inférieure à « investment grade » et émises par des sociétés domiciliées dans des pays développés notées de BB1 à B3, sur la base d'une moyenne de Moody's, S&P et Fitch, et ajuste les pondérations des titres de manière à améliorer le score global de risque environnemental, social et de gouvernance (« ESG ») de l'indice. L'Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified réplique la performance totale des instruments de créance libellés en dollar américain émis par des entités souveraines et quasi-souveraines des marchés émergents, en intégrant des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance dans la construction de l'indice. |
| 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en USD), ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en USD) | L'Indice Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index (couvert en USD) fournit une mesure large des marchés à revenu fixe de qualité « investment grade » des pays développés du monde entier. L'indice ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) reproduit la performance d'obligations de qualité inférieure à « investment grade » et émises par des sociétés domiciliées dans des pays développés dont la dette à long terme en devise étrangère est notée « investment grade » (selon la combinaison des notations de Moody's, S&P et Fitch). L'indice inclut des obligations libellées en dollar américain, en dollar canadien, en livre sterling et en euro (ou autre monnaie ayant précédé l'euro), mais exclut toutes les obligations libellées en plusieurs devises. La notation des obligations doit être inférieure à la qualité « investment grade », mais elle ne peut être inférieure à B3 selon la combinaison des notations de Moody's, S&P et Fitch. Les obligations admissibles sont pondérées par la capitalisation et la répartition totale vers un émetteur individuel (selon la définition des symboles Bloomberg) ne doit pas dépasser 2 %. Les émetteurs dépassant la limite sont réduits à 2 % et la valeur nominale de chacune de leurs obligations est ajustée au prorata. De même, dès lors que la valeur nominale des obligations de tous les autres émetteurs est inférieure au plafond de 2 %, elle est augmentée au prorata. Avant le 25 septembre 2009, les Indices ICE BofA Merrill Lynch Indices s'appelaient Indices Merrill Lynch Indices. L'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD) suit la performance totale des instruments de créance libellés en dollar américain émis par des entités souveraines et quasi souveraines de marchés émergents, les obligations Brady, prêts, euro-obligations et instruments du marché local. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice HIBOR Index à 3 mois | L'Indice HIBOR (Hong Kong Interbank Offered Rate) Index à 3 mois est un taux de référence qui présente la moyenne des taux d'intérêt auxquels un certain nombre de banques désignées par l'Association des banques de Hong Kong sont disposées à se prêter entre elles sans garantie, à des échéances différentes. |
| 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en USD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en USD) | L'indice de référence est composé à 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en USD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (non couvert en USD), et 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD). L'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index mesure la performance des principaux marchés développés des obligations d'État indexées sur l'inflation. Il est pondéré en fonction de la capitalisation boursière et comprend des échéances allant jusqu'à 30 ans. L'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus reproduit la performance totale des instruments du marché monétaire libellés en devise locale de 24 pays émergents. L'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index reflète le rendement de positions entièrement garanties sur les contrats à terme standardisés sous-jacents sur un certain nombre de matières premières physiques. L'indice, très liquide et diversifié, est conçu pour représenter les matières premières en tant que catégorie d'actifs à part entière. L'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière ajustée par le flottant conçu pour suivre la performance de sociétés immobilières cotées du monde entier. L'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index reflète le rendement de positions entièrement garanties sur les contrats à terme standardisés sur matières premières sous-jacents. Il n'est pas possible d'investir dans un indice non géré. |
| 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index et 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD) | L'indice de référence est constitué à 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index et à 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD). L'Indice JPMorgan EMBI Global Index reproduit la performance totale d'instruments de créance libellés en dollar américain et émis par des entités souveraines et quasi souveraines de marchés émergents : obligations Brady, prêts, et euro-obligations. L'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD) est un indice exhaustif des marchés émergents locaux dans le monde entier, et consiste en des obligations d'État en devises locales négociées régulièrement et à des taux fixes liquides auxquelles les investisseurs mondiaux peuvent obtenir une exposition. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en USD) | L'indice de référence est constitué à 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index (ACWI) et à 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond (couvert en USD). L'indice MSCI All Country World Index est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière ajustée par le flottant, visant à évaluer les performances des marchés d'actions développés et émergents. L'indice est composé de 47 indices pays comprenant 23 indices de pays développés et 23 de pays émergents. L'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en USD) offre une mesure à grande échelle des marchés mondiaux du revenu fixe de qualité « investment grade ». Les trois principales composantes de cet indice sont les Indices US Aggregate Index, Pan-European Aggregate Index et Asian-Pacific Aggregate Index. L'indice comporte également des obligations d'entreprises en Eurodollar et Euro-Yen, des titres de l'État canadien et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ». Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |

| Nom officiel des indices de référence | Description des indices |
|---|---|
| 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index et 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index | L'Indice Bloomberg US Aggregate Index (couvert en EUR) représente des titres enregistrés auprès de la SEC imposables et libellés en dollar américain. L'indice couvre le marché des obligations américaines à taux fixe de catégorie « investment grade », avec des composantes en titres d'État et d'entreprises, titres hypothécaires avec flux identiques (« pass-through ») et titres adossés à des actifs. Ces grands secteurs sont subdivisés en indices plus spécifiques, calculés et déclarés régulièrement. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. L'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index se base sur l'Indice MSCI ACWI Index (couvert en EUR), son indice parent, et comprend des actions de grandes et moyennes capitalisations dans 23 pays des marchés développés et 24 pays des marchés émergents. L'indice est conçu pour répliquer la performance des actions de l'indice parent (à l'exclusion des REITS) présentant des caractéristiques de revenu de dividendes et de qualité supérieures aux rendements de dividendes moyens, à la fois durables et persistants. L'indice applique également des filtres pour évaluer la qualité et examine les performances passées sur 12 mois afin d'exclure les actions dont les fondamentaux pourraient se détériorer et les obliger à réduire leurs dividendes. |
| Indice Alerian MLP Index | L'Indice Alerian MLP Index est la mesure la plus répandue des sociétés en commandite principales de grande et moyenne capitalisations du secteur de l'énergie. Il s'agit d'un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière ajustée par le flottant qui comprend 50 grandes sociétés. |
| Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index | L'Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index est un indice non géré représentatif de la performance, sur la base du rendement total, des titres du marché monétaire australien. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg Commodity Index Total Return | L'Indice Bloomberg Commodity Index Total Return est un indice non géré composé de contrats à terme standardisés sur un certain nombre de matières premières physiques. L'indice, très liquide et diversifié, est conçu pour représenter les matières premières en tant que catégorie d'actifs à part entière. Les expositions aux contrats à terme standardisés de l'indice de référence sont garanties par des bons du Trésor américain. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg Euro-Aggregate 1-10 Year Bond Index | L'Indice Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index représente la composante Euro-Aggregate 1-10 Year de l'Indice Bloomberg Pan-European Aggregate Index. L'Indice Bloomberg Euro-Aggregate Index se compose d'obligations émises en euro ou dans les anciennes devises des 17 pays souverains faisant partie de l'Union monétaire européenne (UME). Toutes les émissions doivent être de qualité « investment grade » et consister en des valeurs mobilières à taux fixe assorties d'une échéance résiduelle d'au moins un an. L'Indice Euro-Aggregate Index exclut les titres convertibles, les billets à taux flottant, les titres de rente viagère, les bons de souscription, les titres apparentés à des obligations et les produits structurés. Les German Schuldscheine (quasi-titres de prêt) sont également exclus en raison de leurs limites de transactions et de leur statut hors cote, qui sont une cause d'illiquidité. Le pays d'émission ne fait pas partie des critères de l'indice et les valeurs mobilières des émetteurs en dehors de la zone euro sont incluses si elles répondent aux critères de l'indice. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index | L'Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index est la composante crédit de l'Indice Bloomberg Euro-Aggregate Index. L'Indice Bloomberg Euro-Aggregate Index se compose d'obligations émises en euro ou dans les anciennes devises des 17 pays souverains faisant partie de l'Union monétaire européenne (UME). Toutes les émissions doivent être de qualité « investment grade » et consister en des valeurs mobilières à taux fixe assorties d'une échéance résiduelle d'au moins un an. L'Indice Euro-Aggregate Index exclut les titres convertibles, les billets à taux flottant, les titres de rente viagère, les bons de souscription, les titres apparentés à des obligations et les produits structurés. Les German Schuldscheine (quasi-titres de prêt) sont également exclus en raison de leurs limites de transactions et de leur statut hors cote, qui sont une cause d'illiquidité. Le pays d'émission ne fait pas partie des critères de l'indice et les valeurs mobilières des émetteurs en dehors de la zone euro sont incluses si elles répondent aux critères de l'indice. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index | L'Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index représente la composante de l'exposition aux titres d'État allemand, français et néerlandais dont l'échéance est supérieure à 15 ans de l'Indice Bloomberg Euro-Aggregate Index ; il est constitué d'obligations émises en euro ou dans les anciennes devises des 17 pays souverains faisant partie de l'Union monétaire européenne (UME). Toutes les émissions doivent être de qualité « investment grade » et consister en des valeurs mobilières à taux fixe assorties d'une échéance résiduelle d'au moins un an. L'Indice Euro-Aggregate Index exclut les titres convertibles, les billets à taux flottant, les titres de rente viagère, les bons de souscription, les titres apparentés à des obligations et les produits structurés. Les German Schuldscheine (quasi-titres de prêt) sont également exclus en raison de leurs limites de transactions et de leur statut hors cote, qui sont une cause d'illiquidité. Le pays d'émission ne fait pas partie des critères de l'indice et les valeurs mobilières des émetteurs en dehors de la zone euro sont incluses si elles répondent aux critères de l'indice. |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) | L'Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) offre une mesure à grande échelle des marchés mondiaux du revenu fixe de qualité « investment grade ». Les trois principales composantes de cet indice sont les Indices US Aggregate Index, Pan-European Aggregate Index et Asian-Pacific Aggregate Index. L'indice comporte également des obligations d'entreprises en Eurodollar et Euro-Yen, des titres de l'État canadien et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ». Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD) | L'Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD) est un indice non géré qui mesure à grande échelle les marchés mondiaux du revenu fixe de catégorie « investment grade » dont l'échéance est comprise entre un et cinq ans. Les trois principales composantes de cet indice sont les Indices US Aggregate Index, Pan-European Aggregate Index et Asian-Pacific Aggregate Index. Cet indice exclut les obligations d'État et les obligations titrisées. L'indice comporte également des obligations d'entreprises en Eurodollar et Euro-Yen, des titres canadiens et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ». |

Description des indices de référence (suite)

| Nom officiel des indices de référence | Description des indices |
|--|---|
| Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) | L'Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) est un indice non géré qui mesure à grande échelle les marchés mondiaux du revenu fixe de qualité « investment grade ». Les trois principales composantes de cet indice sont les Indices US Aggregate Index, Pan-European Aggregate Index et Asian-Pacific Aggregate Index. Cet indice exclut les obligations d'État et les obligations titrisées. L'indice comporte également des obligations d'entreprises en Eurodollar et Euro-Yen, des titres canadiens et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ». Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) | L'Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) offre une mesure à grande échelle des marchés mondiaux du revenu fixe de qualité « investment grade ». Les trois principales composantes de cet indice sont les Indices US Aggregate Index, Pan-European Aggregate Index et Asian-Pacific Aggregate Index. L'Indice comporte également des obligations d'entreprises en Eurodollar et Euro-Yen, des titres de l'État canadien, des titres d'agences et d'entreprises, et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ». |
| Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD) | L'Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD) offre aux investisseurs une mesure objective et solide du marché mondial des titres à revenu fixe émis pour financer des projets présentant des avantages environnementaux directs. Une méthodologie indépendante axée sur la recherche est utilisée pour évaluer les obligations vertes éligibles à l'Indice afin de s'assurer qu'elles respectent les principes établis en matière d'obligations vertes et pour classer les obligations en fonction de leur utilisation environnementale des produits. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index | L'Indice Bloomberg US Aggregate Index représente des titres enregistrés auprès de la SEC, imposables et libellés en dollar américain. L'indice couvre le marché des obligations américaines à taux fixe de catégorie « investment grade », avec des composantes en titres d'État et d'entreprises, titres hypothécaires avec flux identiques (« pass-through ») et titres adossés à des actifs. Ces grands secteurs sont subdivisés en indices plus spécifiques, calculés et déclarés régulièrement. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index | L'Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index représente des titres enregistrés auprès de la SEC, imposables et libellés en dollar américain avec une échéance de un à trois ans. L'indice couvre le marché des obligations américaines à taux fixe de catégorie « investment grade », avec des composantes en titres d'État et d'entreprises, titres hypothécaires avec flux identiques (« pass-through ») et titres adossés à des actifs. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg U.S. Credit Index | L'Indice Bloomberg U.S. Credit Index est un indice non géré composé d'obligations et billets garantis d'entreprises américaines cotées et de certaines entreprises non américaines remplissant les conditions définies d'échéance, de liquidité et de qualité. Pour être admissibles, les obligations doivent être enregistrées auprès de la SEC. Cet indice était auparavant dénommé Indice Bloomberg Credit Investment Grade Index. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD) | L'Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD) mesure la performance des principaux marchés des obligations d'État indexées sur l'inflation. Il englobe les dettes indexées sur l'inflation des pays suivants : Australie, Canada, France, Suède, Royaume-Uni et États-Unis. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD) | L'Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD) mesure la performance du marché mondial des obligations d'État indexées sur l'inflation ayant une échéance comprise entre un et cinq ans. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) | Le taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) mesure le coût du financement général à un jour en dollar canadien des garanties en utilisant les bons du Trésor et les obligations du gouvernement du Canada comme garantie des opérations de pension. |
| Indice FTSE 3-Month Treasury Bill Index | L'Indice FTSE 3-Month Treasury Bill Index est un indice non géré représentatif des performances mensuelles équivalentes aux rendements moyens des émissions de bons du Trésor américain des 3 derniers mois. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index | L'Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index est représentatif du marché du revenu fixe de qualité « investment grade » de la zone euro accessibles aux investisseurs institutionnels (en euro). Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index | L'indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index est composé d'une émission unique acquise au début du mois et détenue pendant un mois entier. À la fin du mois, cette émission est vendue et réinvestie dans une émission nouvellement sélectionnée. L'émission sélectionnée lors du rééquilibrage à chaque fin de mois est le bon du Trésor allemand en circulation dont l'échéance est la plus proche d'un délai de trois mois suivant la date de rééquilibrage, sans être inférieure à un mois. Pour pouvoir être sélectionné, le bon du Trésor doit avoir été réglé au plus tard à la date de rééquilibrage de fin de mois. |
| Indice ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index | L'Indice ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index est un indice non géré composé de titres du Trésor américain, autres que les titres de protection contre l'inflation et les STRIPS, dont la valeur nominale en circulation est d'au moins 1 milliard USD et dont l'échéance résiduelle se situe entre un et trois ans. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice ICE BofA 3-Month Treasury Bill Index (couvert en EUR) | L'indice ICE BofA 3-Month Treasury Bill Index (couvert en EUR) se compose d'une émission unique achetée en début de mois et détenue pendant un mois entier. À la fin du mois, cette émission est vendue et réinvestie dans une émission nouvellement sélectionnée. L'émission sélectionnée lors du rééquilibrage à chaque fin de mois est le bon du Trésor en circulation dont l'échéance est la plus proche d'un délai de trois mois suivant la date de rééquilibrage, sans dépasser cette limite. Pour pouvoir être sélectionnée, une émission doit avoir été réglée au plus tard à la date de rééquilibrage de fin de mois. Bien que l'indice détienne souvent le bon du Trésor émis lors de la plus récente enchère de 3 mois, il est aussi possible de choisir un bon du Trésor de 6 mois plus ancien. |

| Nom officiel des indices de référence | Description des indices |
|---|---|
| Indice ICE BofA BB-B European Currency High Yield Constrained Index | L'Indice ICE BofA BB-B European Currency High Yield Constrained Index est conçu pour suivre la performance de titres de créance d'entreprises de qualité inférieure à « investment grade » libellés en euro et en livre sterling émis publiquement sur les marchés des euro-obligations, et les marchés nationaux en livre sterling ou en euro. Pour pouvoir être incluses dans l'Indice, les obligations doivent avoir une notation inférieure à la qualité « investment grade » ; leur notation ne peut cependant pas être inférieure à B3 selon la moyenne des notations de Moody's, S&P et Fitch. L'exposition aux émetteurs individuels au sein de l'Indice est plafonnée à 3 %. |
| Indice ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD | L'Indice ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD reproduit la performance d'obligations de qualité inférieure à « investment grade » et émises par des sociétés domiciliées dans des pays développés dont la dette à long terme en devise étrangère est notée « investment grade » (selon la combinaison des notations de Moody's, S&P et Fitch). L'Indice inclut des obligations libellées en dollar américain, en dollar canadien, en livre sterling et en euro (ou dans une autre devise ayant précédé l'euro), mais exclut toutes les obligations libellées en plusieurs devises. La notation des obligations doit être inférieure à la qualité « investment grade », mais elle ne peut être inférieure à B3 selon la combinaison des notations de Moody's, S&P et Fitch. Les obligations admissibles sont pondérées par la capitalisation et la répartition totale vers un émetteur individuel (selon la définition des symboles Bloomberg) ne doit pas dépasser 2 %. Les émetteurs dépassant la limite sont réduits à 2 % et la valeur nominale de chacune de leurs obligations est ajustée au prorata. De même, dès lors que la valeur nominale des obligations de tous les autres émetteurs est inférieure au plafond de 2 %, elle est augmentée au prorata. Avant le 25 septembre 2009, les Indices ICE BofA Merrill Lynch Indices s'appelaient Indices Merrill Lynch Indices. |
| Indice ICE BofA Sterling Non-Gilts 10+ Index | L'Indice ICE BofA Sterling Non-Gilts 10+ Index est constitué d'obligations de qualité « investment grade » libellées en livre sterling, à l'exclusion des obligations libellées en livre sterling émises par le Gouvernement britannique. Toutes les obligations de l'indice doivent être notées « investment grade » par au moins une des grandes agences de notation. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice ICE BofA Sterling Non-Gilts Index | L'Indice ICE BofA Sterling Non-Gilts Index suit la performance de la dette publique de qualité « investment grade » libellée en livre sterling des émetteurs privés, quasi-gouvernementaux et souverains non britanniques. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice ICE BofA U.S. High Yield Constrained Index | L'Indice ICE BofA U.S. High Yield Constrained Index suit la performance de la dette d'entreprises libellée en dollar américain et ayant une note inférieure à « investment grade » émise de manière publique sur le marché local américain. Les titres éligibles doivent être assortis d'une notation inférieure à « investment grade » (sur la base de la moyenne de Moody's, S&P et Fitch) et être émis par un pays dont la notation de risque est « investment grade » (sur la base de la notation moyenne des emprunts souverains à long terme en devises étrangères de Moody's, S&P et Fitch). |
| Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index | L'Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index réplique la performance d'un actif synthétique payant SARON à une échéance déterminée. L'indice repose sur l'achat supposé à la valeur nominale d'un instrument synthétique dont l'échéance correspond exactement à l'échéance fixée et dont le coupon est égal au taux de fixation du jour. Cette émission est supposée être vendue le jour ouvrable suivant (à un prix égal au taux de fixation du jour) et transformée en un nouvel instrument. |
| Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index | L'Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index réplique la performance d'un actif synthétique payant SOFR à une échéance déterminée. L'indice repose sur l'achat supposé à la valeur nominale d'un instrument synthétique dont l'échéance correspond exactement à l'échéance fixée et dont le coupon est égal au taux de fixation du jour. Cette émission est supposée être vendue le jour ouvrable suivant (à un prix égal au taux de fixation du jour) et transformée en un nouvel instrument. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index | L'Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index réplique la performance d'un actif synthétique payant SONIA à une échéance déterminée. L'indice repose sur l'achat supposé à la valeur nominale d'un instrument synthétique dont l'échéance correspond exactement à l'échéance fixée et dont le coupon est égal au taux de fixation du jour. Cette émission est supposée être vendue le jour ouvrable suivant (à un prix égal au taux de fixation du jour) et transformée en un nouvel instrument. |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index | L'Indice JPMorgan Asia Credit Index mesure la performance des marchés d'obligations libellées en dollar américain des marchés d'Asie hors Japon. L'indice fournit une référence pour les opportunités d'investissement dans les instruments à revenu fixe libellés en dollar américain émis par les émetteurs souverains, quasi-souverains et les entreprises de l'Asie hors Japon. |
| Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) | L'Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) est une version uniquement pondérée de l'Indice CEMBI Index. Il limite les pondérations des indices des pays présentant d'importantes obligations d'entreprises par la seule inclusion d'une partie déterminée des montants nominaux actuels des obligations en circulation éligibles de ces pays. L'Indice CEMBI Diversified Index affiche donc des pondérations bien réparties et plus équilibrées des pays qui y sont représentés. Les pays que couvre l'Indice CEMBI Diversified Index sont identiques à ceux couverts par l'Indice CEMBI Index. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert) | L'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert) reproduit la performance totale des instruments monétaires libellés en devise locale de 22 pays émergents dont le commerce extérieur est supérieur ou égal à 10 milliards USD. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | L'indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global reproduit la performance des titres de créance libellés en dollar américain et émis par des entités souveraines ou quasi-souveraines de marchés émergents. |
| Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified | L'Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified reproduit la performance totale des instruments de créance libellés en dollar américain émis par des entités souveraines et quasi-souveraines des marchés émergents intégrant des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance à la construction de l'indice. |

Description des indices de référence (suite)

| Nom officiel des indices de référence | Description des indices |
|--|---|
| Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index | L'Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified (JESG GBI-EM) reproduit la performance des obligations émises par les gouvernements des marchés émergents et libellées dans la devise locale de l'émetteur. L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG (facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance) pour favoriser les émetteurs les mieux classés selon les critères ESG et les émissions d'obligations vertes, et pour sous-pondérer ou éliminer les émetteurs moins bien classés. |
| Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert) | L'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert) représente un indice exhaustif des marchés émergents locaux dans le monde entier, et consiste en des obligations d'État en devises locales négociées régulièrement et à des taux fixes liquides auxquelles les investisseurs mondiaux peuvent obtenir une exposition. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index Composite Total Return (couvert en EUR) | L'Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en EUR) mesure la performance des marchés d'obligations libellées en dollar américain des marchés d'Asie hors Japon. L'indice fournit une référence pour les opportunités d'investissement dans les instruments à revenu fixe libellés en dollar américain émis par les émetteurs souverains, quasi-souverains et les entreprises de l'Asie hors Japon. |
| Indice JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade | L'Indice JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade comprend des obligations à rendement élevé et à taux fixe libellées en dollar américain, émises par des emprunteurs souverains ou quasi-souverains, des banques et des entreprises asiatiques. L'Indice JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade existant comprend à la fois des obligations à taux fixe et à taux flottant émises par des entités domiciliées en Asie ayant un encours nominal d'au moins 150 millions USD et plus d'un an restant à courir jusqu'à l'échéance. |
| Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres) | L'Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres) est un indice diversifié au niveau mondial qui couvre un univers étendu d'opportunités à revenu fixe et de secteurs dans le monde entier, allant des marchés développés aux marchés émergents, des actifs virtuels aux actifs réels et des liquidités aux instruments dérivés. À la différence des indices classiques, le plus souvent composés d'obligations pondérées en fonction de leur capitalisation boursière, le GLADI utilise les pondérations des PIB, mettant ainsi l'accent sur les régions du monde à croissance rapide ce qui donne à l'indice une nature prévisionnelle. La méthodologie GLADI de PIMCO est une propriété intellectuelle couverte par le brevet américain numéro 8 306 892. GLOBAL ADVANTAGE et GLADI sont des marques déposées de Pacific Investment Management Company LLC. |
| Indice S&P 500 Index | L'indice S&P 500 Index est un indice non géré, considéré généralement comme représentatif du marché d'actions dans son ensemble. L'indice privilégie le segment des grandes capitalisations du marché d'actions américain. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Taux sans risque au jour le jour du Shekel SHIR | Cet indice reflète le taux d'intérêt au jour le jour en shekel et est égal au taux de la Banque d'Israël, sauf les jours où le SHIR n'est pas publié, sa valeur sera celle du dernier jour où il a été publié. Le taux de la Banque d'Israël est déterminé par le Comité monétaire de la Banque d'Israël huit fois par an, généralement le lundi à 16 h 00. Les dates de publication et d'application du taux d'intérêt de la Banque d'Israël sont publiées chaque année sur le site Internet de la Banque d'Israël. Le SHIR sera publié sur le site Internet de la Banque d'Israël avant 11 h 00 chaque jour, à l'exception des samedis, des dimanches et des dates supplémentaires publiées chaque année sur le site Internet de la Banque d'Israël, et qui seront mises à jour périodiquement. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. |
| Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA | Le taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour (SORA) est le taux moyen pondéré en fonction du volume des transactions d'emprunt sur le marché interbancaire en dollar de Singapour au jour le jour sans garantie à Singapour. |

Bilan

| (Montants en milliers) | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | |
|--|--|------------------------|--|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 2 167 937 | \$ 2 652 171 | \$ 160 430 | \$ 276 959 |
| Fonds d'investissement | 212 144 | 239 979 | 11 571 | 29 746 |
| Contrats de mise en pension | 3 856 | 20 572 | 252 | 820 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 22 105 | 54 267 | 1 399 | 3 700 |
| Liquidités | 1 043 | 0 | 432 | 546 |
| Dépôts auprès de contreparties | 29 911 | 34 314 | 1 742 | 2 017 |
| Produits à recevoir | 37 487 | 48 231 | 2 427 | 3 836 |
| À recevoir sur investissements vendus | 59 339 | 18 600 | 4 588 | 0 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 505 | 5 111 | 851 | 119 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 31 996 | 14 965 | 422 | 1 946 |
| Autres actifs | 150 | 0 | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 2 566 473 | 3 088 210 | 184 114 | 319 689 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (13 307) | (27 401) | (756) | (1 065) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur investissements achetés | (60 920) | (3 578) | (4 588) | 0 |
| À payer sur investissements achetés TBA | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (1 920) | (11 061) | (173) | (76) |
| Frais de gestion à payer | (1 379) | (1 671) | (100) | (164) |
| À payer sur contrats de prise en pension | (12 951) | 0 | (505) | 0 |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Charges à payer | (94) | (41) | 0 | 0 |
| Découvert bancaire | 0 | (13 527) | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | (141) | (161) | (1) | 0 |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (37 183) | (25 632) | (783) | (1 842) |
| Dépôts des contreparties | (3 850) | (23 746) | 0 | (2 555) |
| Autres passifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (131 745) | (106 818) | (6 906) | (5 702) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 2 434 728 | \$ 2 981 392 | \$ 177 208 | \$ 313 987 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(1) Le Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund a été renommé Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund le 29 novembre 2023.

| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund ⁽¹⁾ | | Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | Fonds PIMCO Climate Bond Fund | | Fonds Commodity Real Return Fund | |
|--|---------------------|-------------------------------------|---------------------|-------------------------------|---------------------|----------------------------------|---------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| \$ 767 569 | \$ 473 435 | \$ 5 268 327 | \$ 6 129 600 | \$ 249 832 | \$ 248 281 | \$ 1 293 427 | \$ 1 750 918 |
| 881 | 251 489 | 147 | 140 | 0 | 0 | 127 | 120 |
| 12 604 | 18 536 | 7 572 | 10 172 | 5 800 | 36 800 | 83 018 | 59 113 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 13 769 | 29 087 | 64 207 | 107 561 | 4 659 | 8 236 | 25 732 | 45 313 |
| 592 | 12 189 | 0 | 2 624 | 1 074 | 1 484 | 2 517 | 4 491 |
| 6 088 | 40 674 | 55 029 | 110 882 | 3 188 | 8 041 | 15 924 | 39 055 |
| 1 876 | 1 307 | 55 730 | 66 969 | 2 454 | 2 192 | 3 578 | 4 250 |
| 2 752 | 4 838 | 2 691 | 33 701 | 0 | 0 | 679 | 50 448 |
| 290 704 | 90 163 | 0 | 0 | 0 | 0 | 106 892 | 206 413 |
| 8 328 | 270 | 6 536 | 3 060 | 169 | 363 | 1 490 | 5 062 |
| 14 527 | 35 050 | 46 739 | 54 526 | 3 546 | 1 167 | 11 129 | 17 822 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1 119 690 | 957 038 | 5 506 978 | 6 519 235 | 270 722 | 306 564 | 1 544 513 | 2 183 005 |
| (16 776) | (43 855) | (62 651) | (86 485) | (4 527) | (5 599) | (40 086) | (50 044) |
| (2 036) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2 585) | (1 870) | (540) | (1) | 0 | 0 | (40 534) | 0 |
| (408 618) | (117 381) | 0 | 0 | 0 | 0 | (190 314) | (288 321) |
| (212) | (10 695) | (5 504) | (7 922) | (72) | (193) | (3 763) | (3 460) |
| (800) | (793) | (4 248) | (4 729) | (128) | (145) | (768) | (1 261) |
| 0 | 0 | (232 205) | (578 475) | (803) | 0 | (396 058) | (425 302) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (17 959) |
| (45) | (3) | (206) | (237) | 0 | (24) | (7) | (15) |
| 0 | 0 | (609) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (6) | (40) | (1 070) | (906) | (276) | (157) | (93) | (336) |
| (11 712) | (18 837) | (32 876) | (77 568) | (2 060) | (3 321) | (5 728) | (18 239) |
| (6 784) | (13 488) | (29 183) | (41 321) | (540) | (4 470) | (8 260) | (8 191) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (449 574) | (206 962) | (369 092) | (797 644) | (8 406) | (13 909) | (685 611) | (813 128) |
| \$ 670 116 | \$ 750 076 | \$ 5 137 886 | \$ 5 721 591 | \$ 262 316 | \$ 292 655 | \$ 858 902 | \$ 1 369 877 |

Bilan (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | Fonds Diversified Income Fund | |
|--|---|------------------------|----------------------------------|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 120 305 | \$ 80 195 | \$ 6 280 493 | \$ 6 620 617 |
| Fonds d'investissement | 3 607 | 9 649 | 739 526 | 876 630 |
| Contrats de mise en pension | 737 | 6 910 | 1 221 471 | 1 746 323 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 1 941 | 2 563 | 157 414 | 132 621 |
| Liquidités | 196 | 177 | 0 | 0 |
| Dépôts auprès de contreparties | 1 630 | 1 533 | 211 549 | 282 594 |
| Produits à recevoir | 1 062 | 1 002 | 77 767 | 83 844 |
| À recevoir sur investissements vendus | 1 | 206 | 9 984 | 51 445 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 39 677 | 1 296 | 1 262 381 | 248 272 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 66 | 138 | 11 388 | 5 685 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 1 083 | 1 075 | 46 900 | 113 759 |
| Autres actifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 170 305 | 104 744 | 10 018 873 | 10 161 790 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (1 789) | (2 137) | (67 651) | (150 759) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur investissements achetés | (3 608) | (304) | (86 708) | (586 220) |
| À payer sur investissements achetés TBA | (59 979) | (3 587) | (2 159 820) | (549 539) |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (6) | (50) | (11 377) | (7 240) |
| Frais de gestion à payer | (91) | (89) | (6 585) | (8 022) |
| À payer sur contrats de prise en pension | (2 942) | 0 | (49 676) | (6 646) |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Charges à payer | 0 | 0 | (155) | (148) |
| Découvert bancaire | 0 | 0 | (531) | (3 465) |
| Dividendes à payer | 0 | 0 | (3 455) | (3 841) |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (793) | (833) | (123 820) | (62 209) |
| Dépôts des contreparties | (1 034) | (591) | (69 297) | (31 905) |
| Autres passifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (70 242) | (7 591) | (2 579 075) | (1 409 994) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 100 063 | \$ 97 153 | \$ 7 439 798 | \$ 8 751 796 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | | Fonds Diversified Income ESG Fund | | Fonds Dynamic Bond Fund | | Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | |
|--|------------------------|--------------------------------------|------------------------|----------------------------|------------------------|-----------------------------------|------------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| \$ 363 886 | \$ 401 584 | \$ 51 106 | \$ 9 978 | \$ 4 176 007 | \$ 2 712 201 | € 3 381 141 | € 4 130 924 |
| 40 652 | 55 806 | 5 470 | 0 | 337 503 | 348 722 | 312 665 | 504 414 |
| 69 552 | 102 832 | 3 000 | 0 | 734 416 | 1 145 692 | 358 849 | 124 604 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 21 706 | 19 178 | 517 | 60 | 70 864 | 74 933 | 130 271 | 234 476 |
| 856 | 513 | 419 | 108 | 9 665 | 7 730 | 29 609 | 38 251 |
| 20 514 | 20 323 | 367 | 113 | 90 899 | 96 997 | 319 479 | 395 426 |
| 4 588 | 5 122 | 649 | 112 | 19 762 | 16 752 | 18 511 | 5 003 |
| 2 756 | 1 998 | 0 | 0 | 116 | 7 837 | 3 973 | 9 331 |
| 88 965 | 19 854 | 8 774 | 603 | 1 853 086 | 454 635 | 965 122 | 0 |
| 58 | 98 | 0 | 0 | 5 110 | 2 056 | 1 770 | 2 321 |
| 21 368 | 19 031 | 268 | 27 | 83 836 | 69 677 | 47 148 | 165 342 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 634 901 | 646 339 | 70 570 | 11 001 | 7 381 264 | 4 937 232 | 5 568 538 | 5 610 092 |
| (5 107) | (5 030) | (402) | (73) | (112 104) | (160 788) | (53 086) | (236 948) |
| 0 | 0 | (970) | 0 | (82 577) | (82 152) | 0 | 0 |
| (32 509) | (940) | (161) | 0 | (162 221) | (557 164) | (36 114) | (21 731) |
| (143 391) | (39 365) | (11 118) | (1 000) | (3 458 082) | (607 223) | (2 003 102) | 0 |
| (345) | (2 623) | (189) | 0 | (1 357) | (600) | (7 846) | (13 813) |
| (330) | (438) | (34) | (6) | (2 660) | (2 772) | (3 382) | (5 575) |
| (529) | 0 | 0 | 0 | (1 354) | (2 164) | 0 | (17 828) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1) | (2) | 0 | 0 | (681) | (68) | (27) | (33) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1 027) | (870) | 0 | 0 | (1 043) | (680) | (65) | 0 |
| (35 680) | (29 190) | (133) | (68) | (33 384) | (28 530) | (141 264) | (115 772) |
| (3 143) | (3 197) | 0 | 0 | (80 228) | (11 490) | (61 607) | (83 222) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (222 062) | (81 655) | (13 007) | (1 147) | (3 935 691) | (1 453 631) | (2 306 493) | (494 922) |
| \$ 412 839 | \$ 564 684 | \$ 57 563 | \$ 9 854 | \$ 3 445 573 | \$ 3 483 601 | € 3 262 045 | € 5 115 170 |

Bilan (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds Emerging Local Bond Fund | | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | |
|--|-----------------------------------|------------------------|---------------------------------------|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 2 843 626 | \$ 1 772 984 | \$ 83 869 | \$ 6 270 |
| Fonds d'investissement | 233 751 | 131 643 | 0 | 0 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 0 | 15 600 | 0 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 48 155 | 7 054 | 134 | 4 |
| Instruments financiers dérivés | 135 418 | 315 328 | 1 505 | 269 |
| Liquidités | 16 830 | 35 990 | 961 | 127 |
| Dépôts auprès de contreparties | 68 149 | 51 091 | 1 388 | 39 |
| Produits à recevoir | 49 909 | 35 522 | 1 604 | 122 |
| À recevoir sur investissements vendus | 222 222 | 26 063 | 10 117 | 0 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 0 | 0 | 344 | 0 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 1 423 | 4 086 | 0 | 0 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 70 465 | 102 125 | 1 372 | 11 |
| Autres actifs | 0 | 17 | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 3 689 948 | 2 481 903 | 116 894 | 6 842 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (134 807) | (313 285) | (1 041) | (215) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur investissements achetés | (296 249) | (28 070) | (10 705) | 0 |
| À payer sur investissements achetés TBA | 0 | 0 | (343) | 0 |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (610) | (665) | 0 | 0 |
| Frais de gestion à payer | (2 257) | (1 496) | (60) | (4) |
| À payer sur contrats de prise en pension | (281 349) | (85 313) | (722) | 0 |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Charges à payer | (835) | (206) | (22) | (2) |
| Découvert bancaire | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (61 675) | (83 123) | (1 523) | (12) |
| Dépôts des contreparties | (31 163) | (50 077) | (70) | 0 |
| Autres passifs | (62) | 0 | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (809 007) | (562 235) | (14 486) | (233) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 2 880 941 | \$ 1 919 668 | \$ 102 408 | \$ 6 609 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds Emerging Markets Bond Fund | | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | | Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | |
|-------------------------------------|------------------------|---|------------------------|---|------------------------|--|------------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| \$ 3 933 972 | \$ 3 267 661 | \$ 2 833 512 | \$ 2 422 256 | \$ 148 275 | \$ 143 387 | \$ 264 943 | \$ 181 600 |
| 192 346 | 52 797 | 0 | 0 | 6 863 | 16 518 | 836 | 14 797 |
| 2 599 | 9 160 | 13 694 | 44 661 | 993 | 8 386 | 6 274 | 706 |
| 60 900 | 2 227 | 45 181 | 1 659 | 2 753 | 0 | 5 043 | 137 |
| 71 306 | 69 071 | 55 089 | 56 599 | 2 340 | 4 439 | 30 376 | 34 841 |
| 11 960 | 4 943 | 7 900 | 2 605 | 805 | 262 | 2 267 | 1 447 |
| 32 680 | 49 025 | 23 558 | 25 425 | 1 732 | 1 839 | 13 141 | 10 495 |
| 65 470 | 52 462 | 46 301 | 37 299 | 2 052 | 1 915 | 3 143 | 1 549 |
| 3 198 | 400 | 12 207 | 215 | 259 | 1 | 20 374 | 207 |
| 162 903 | 26 106 | 128 924 | 4 814 | 5 331 | 1 285 | 22 390 | 0 |
| 32 733 | 714 | 7 335 | 10 705 | 6 | 55 | 357 | 0 |
| 19 143 | 25 590 | 11 359 | 10 516 | 707 | 984 | 6 457 | 5 129 |
| 0 | 0 | 14 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4 589 210 | 3 560 156 | 3 185 074 | 2 616 754 | 172 116 | 179 071 | 375 601 | 250 908 |
| (43 533) | (49 305) | (30 895) | (23 713) | (1 329) | (618) | (29 047) | (31 528) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (16 221) | (10 331) | (6 098) | (3 745) | (1 746) | (2 163) | (21 839) | 0 |
| (217 275) | (49 405) | (128 520) | (7 710) | (8 675) | (2 563) | (22 311) | 0 |
| (1 778) | (13 371) | (2 002) | (461) | (80) | (10) | (24) | (586) |
| (2 776) | (2 521) | (2 046) | (1 929) | (159) | (172) | (99) | (64) |
| (402 727) | (75 356) | (214 833) | (38 840) | (166) | 0 | (5 271) | 0 |
| 0 | 0 | (56 665) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (83) | (12) | (53) | (1) | (3) | 0 | (2) | (8) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (317) | (276) | (2 039) | (2 167) | 0 | 0 | (1) | 0 |
| (33 004) | (15 372) | (19 603) | (9 012) | (974) | (1 872) | (13 257) | (10 037) |
| (25 211) | (38 228) | (28 399) | (36 701) | (1 271) | (2 687) | (960) | (3 554) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (742 925) | (254 177) | (491 153) | (124 279) | (14 403) | (10 085) | (92 811) | (45 777) |
| \$ 3 846 285 | \$ 3 305 979 | \$ 2 693 921 | \$ 2 492 475 | \$ 157 713 | \$ 168 986 | \$ 282 790 | \$ 205 131 |

Bilan (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | Fonds PIMCO ESG Income Fund | |
|--|---|------------------|--------------------------------|-------------------|
| | Au | Au | Au | Au |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 17 763 | \$ 15 264 | \$ 274 526 | \$ 254 108 |
| Fonds d'investissement | 1 837 | 2 058 | 0 | 0 |
| Contrats de mise en pension | 158 | 2 766 | 8 200 | 44 400 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 363 | 78 | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 1 223 | 4 060 | 7 131 | 5 555 |
| Liquidités | 153 | 185 | 1 059 | 1 533 |
| Dépôts auprès de contreparties | 305 | 282 | 2 915 | 2 737 |
| Produits à recevoir | 112 | 87 | 1 980 | 1 372 |
| À recevoir sur investissements vendus | 233 | 1 | 20 | 80 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 976 | 0 | 28 121 | 78 252 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 7 | 11 | 459 | 221 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 233 | 254 | 5 731 | 4 814 |
| Autres actifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 23 363 | 25 046 | 330 142 | 393 072 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (803) | (3 067) | (5 389) | (4 277) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | 0 | 0 | (443) | (2 630) |
| À payer sur investissements achetés | (1 028) | (109) | (138) | (707) |
| À payer sur investissements achetés TBA | (970) | 0 | (45 457) | (141 114) |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (1) | (5) | (52) | (12) |
| Frais de gestion à payer | (24) | (25) | (146) | (118) |
| À payer sur contrats de prise en pension | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Charges à payer | 0 | (1) | (2) | (12) |
| Découvert bancaire | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | 0 | 0 | (1) | (1) |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (320) | (631) | (2 491) | (3 190) |
| Dépôts des contreparties | (271) | (271) | (4 815) | (3 050) |
| Autres passifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (3 417) | (4 109) | (58 934) | (155 111) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 19 946 | \$ 20 937 | \$ 271 208 | \$ 237 961 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds Euro Bond Fund | | Fonds Euro Credit Fund | | Fonds Euro Income Bond Fund | | Fonds Euro Long Average Duration Fund | |
|----------------------|---------------------|------------------------|---------------------|-----------------------------|---------------------|---------------------------------------|---------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| € 1 547 627 | € 1 747 790 | € 536 515 | € 491 678 | € 1 698 144 | € 1 100 441 | € 890 605 | € 103 959 |
| 164 208 | 181 654 | 9 501 | 50 689 | 135 514 | 134 815 | 38 073 | 4 940 |
| 97 581 | 11 515 | 14 437 | 44 621 | 137 975 | 120 458 | 52 334 | 1 500 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 52 302 | 49 805 | 5 984 | 9 083 | 45 840 | 26 003 | 18 572 | 3 789 |
| 3 541 | 3 052 | 3 470 | 12 028 | 17 714 | 7 361 | 1 236 | 397 |
| 37 643 | 59 589 | 8 072 | 26 366 | 49 751 | 47 460 | 20 472 | 4 382 |
| 10 531 | 8 903 | 6 584 | 4 187 | 10 060 | 8 869 | 12 456 | 1 039 |
| 200 | 13 467 | 0 | 2 447 | 228 | 53 521 | 554 | 0 |
| 319 172 | 168 280 | 46 380 | 1 073 | 615 833 | 117 074 | 91 778 | 6 332 |
| 1 039 | 932 | 721 | 242 | 5 934 | 1 107 | 3 473 | 51 |
| 12 883 | 105 486 | 10 537 | 33 489 | 33 918 | 19 325 | 4 174 | 16 625 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2 246 727 | 2 350 473 | 642 201 | 675 903 | 2 750 911 | 1 636 434 | 1 133 727 | 143 014 |
| (32 678) | (122 819) | (5 319) | (13 081) | (23 982) | (27 457) | (8 349) | (18 830) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (95) | 0 | (7 404) | (190) | (22 578) | (3 877) | 0 |
| (488 304) | (264 938) | (79 001) | (13 488) | (1 248 173) | (208 728) | (159 831) | (11 721) |
| (1 343) | (405) | (443) | (85) | (1 212) | (1 033) | (70) | 0 |
| (702) | (807) | (228) | (252) | (1 266) | (1 244) | (324) | (46) |
| (1 041) | 0 | (8 176) | 0 | (4 268) | 0 | (10 485) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (6) | (5) | 0 | 0 | (21) | (17) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (34 354) | (41 188) | (10 718) | (29 619) | (56 332) | (18 036) | (23 159) | (2 369) |
| (16 586) | (6 941) | (1 130) | (1 966) | (28 240) | (4 361) | (3 663) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (575 014) | (437 198) | (105 015) | (65 895) | (1 363 684) | (283 454) | (209 758) | (32 966) |
| € 1 671 713 | € 1 913 275 | € 537 186 | € 610 008 | € 1 387 227 | € 1 352 980 | € 923 969 | € 110 048 |

Bilan (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds Euro Short-Term Fund | | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | |
|--|-------------------------------|------------------------|--|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | € 174 163 | € 330 698 | € 306 261 | € 157 222 |
| Fonds d'investissement | 0 | 0 | 18 291 | 8 700 |
| Contrats de mise en pension | 12 400 | 14 100 | 30 300 | 3 700 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 208 | 5 409 | 4 615 | 2 007 |
| Liquidités | 448 | 896 | 2 070 | 3 440 |
| Dépôts auprès de contreparties | 1 628 | 6 396 | 9 203 | 2 986 |
| Produits à recevoir | 1 173 | 1 735 | 4 039 | 1 897 |
| À recevoir sur investissements vendus | 1 971 | 63 | 1 | 32 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 2 058 | 550 | 981 | 71 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 702 | 5 754 | 2 730 | 1 485 |
| Autres actifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 194 751 | 365 601 | 378 491 | 181 540 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (1 031) | (2 312) | (924) | (1 105) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur investissements achetés | 0 | 0 | (1 470) | (4 181) |
| À payer sur investissements achetés TBA | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (143) | (1 514) | (158) | (1) |
| Frais de gestion à payer | (63) | (105) | (99) | (13) |
| À payer sur contrats de prise en pension | 0 | 0 | (1 858) | 0 |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Charges à payer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Découvert bancaire | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 0 | (6 452) | (5 955) | (2 078) |
| Dépôts des contreparties | 0 | (2 123) | (260) | 0 |
| Autres passifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (1 237) | (12 506) | (10 724) | (7 378) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | € 193 514 | € 353 095 | € 367 767 | € 174 162 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | | Fonds Global Advantage Fund | | Fonds Global Bond Fund | | Fonds Global Bond ESG Fund | |
|--|---------------------|-----------------------------|---------------------|------------------------|---------------------|----------------------------|---------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| € 132 036 | € 193 346 | \$ 558 153 | \$ 443 632 | \$ 14 935 571 | \$ 11 361 097 | \$ 3 995 935 | \$ 2 913 880 |
| 7 680 | 18 800 | 18 210 | 18 242 | 1 311 189 | 1 120 979 | 0 | 5 649 |
| 1 000 | 4 400 | 534 | 1 408 | 371 917 | 1 346 970 | 165 958 | 1 157 847 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2 387 | 7 774 | 29 981 | 25 927 | 701 868 | 518 391 | 194 051 | 94 009 |
| 383 | 640 | 3 823 | 3 907 | 51 511 | 32 207 | 13 203 | 8 552 |
| 1 906 | 4 772 | 15 196 | 15 524 | 497 830 | 478 539 | 110 870 | 125 721 |
| 955 | 1 077 | 3 128 | 2 702 | 59 192 | 51 007 | 18 670 | 10 094 |
| 698 | 1 622 | 8 712 | 9 551 | 277 948 | 279 220 | 26 215 | 26 307 |
| 16 715 | 12 293 | 271 238 | 96 161 | 6 650 551 | 4 755 367 | 1 499 812 | 450 850 |
| 635 | 293 | 1 | 3 | 24 912 | 77 660 | 4 091 | 3 518 |
| 2 956 | 4 861 | 18 679 | 22 907 | 406 567 | 658 178 | 102 970 | 164 909 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 167 351 | 249 878 | 927 655 | 639 964 | 25 289 056 | 20 679 615 | 6 131 775 | 4 961 336 |
| (5 140) | (8 310) | (22 347) | (21 316) | (696 202) | (859 558) | (119 746) | (151 501) |
| 0 | 0 | (42 127) | (28 813) | (930 028) | (721 316) | (277 758) | (119 122) |
| 0 | (590) | (8 490) | (8 457) | (346 698) | (930 760) | (116 439) | (622 586) |
| (30 198) | (23 393) | (391 325) | (140 479) | (9 559 374) | (6 231 107) | (1 839 724) | (792 022) |
| (68) | (111) | (49) | (35) | (57 022) | (13 836) | (4 171) | (10 843) |
| (45) | (66) | (256) | (250) | (6 410) | (5 736) | (1 426) | (1 314) |
| 0 | 0 | 0 | (1 504) | (617) | (1 682) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (21) | (17) | (173) | (137) | (7) | (3) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (642) | (736) | (485) | (399) |
| (663) | (5 044) | (20 035) | (23 802) | (451 767) | (407 767) | (131 420) | (125 388) |
| (627) | (1 192) | (10 715) | (4 832) | (162 861) | (86 868) | (79 419) | (31 968) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (36 741) | (38 706) | (495 365) | (229 505) | (12 211 794) | (9 259 503) | (2 570 595) | (1 855 146) |
| € 130 610 | € 211 172 | \$ 432 290 | \$ 410 459 | \$ 13 077 262 | \$ 11 420 112 | \$ 3 561 180 | \$ 3 106 190 |

Bilan (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds Global Bond Ex-US Fund | | Fonds Global High Yield Bond Fund | |
|--|---------------------------------|------------------------|--------------------------------------|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 962 952 | \$ 737 412 | \$ 2 863 479 | \$ 2 850 786 |
| Fonds d'investissement | 10 172 | 47 322 | 76 320 | 201 583 |
| Contrats de mise en pension | 1 005 | 1 625 | 0 | 11 412 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 48 425 | 35 105 | 17 367 | 36 885 |
| Liquidités | 8 288 | 5 507 | 1 951 | 26 |
| Dépôts auprès de contreparties | 41 103 | 39 796 | 34 091 | 28 611 |
| Produits à recevoir | 4 201 | 3 559 | 41 913 | 40 375 |
| À recevoir sur investissements vendus | 16 167 | 15 805 | 2 737 | 23 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 509 310 | 255 052 | 0 | 0 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 3 753 | 460 | 7 590 | 7 615 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 32 367 | 56 123 | 11 285 | 788 |
| Autres actifs | 0 | 0 | 95 | 223 |
| Total de l'actif à court terme | 1 637 743 | 1 197 766 | 3 056 828 | 3 178 327 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (48 860) | (63 177) | (7 830) | (20 824) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | (97 971) | (76 200) | 0 | 0 |
| À payer sur investissements achetés | (15 657) | (15 641) | (17 070) | 0 |
| À payer sur investissements achetés TBA | (627 293) | (282 153) | 0 | 0 |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (1 908) | (75) | (3 108) | (13 817) |
| Frais de gestion à payer | (370) | (342) | (1 825) | (1 960) |
| À payer sur contrats de prise en pension | 0 | 0 | (20 553) | (10 397) |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Charges à payer | (6) | (7) | (23) | (123) |
| Découvert bancaire | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | 0 | 0 | (3 511) | (4 126) |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (42 188) | (41 421) | (9 588) | (3 436) |
| Dépôts des contreparties | (3 364) | (2 728) | (13 070) | (20 776) |
| Autres passifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (837 617) | (481 744) | (76 578) | (75 459) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 800 126 | \$ 716 022 | \$ 2 980 250 | \$ 3 102 868 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | Fonds Global Low Duration Real Return Fund | | Fonds Global Real Return Fund | |
|--|------------------------|--|------------------------|---|------------------------|----------------------------------|------------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| \$ 10 091 319 | \$ 9 778 544 | \$ 2 410 642 | \$ 1 489 771 | \$ 1 923 658 | \$ 1 661 693 | \$ 3 700 069 | \$ 3 391 396 |
| 1 045 218 | 1 038 326 | 0 | 0 | 506 | 12 424 | 23 397 | 7 043 |
| 177 113 | 75 423 | 1 300 | 15 240 | 2 889 | 1 053 | 2 878 | 2 245 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 179 275 | 212 298 | 34 989 | 33 293 | 28 421 | 50 766 | 53 168 | 106 832 |
| 18 362 | 20 756 | 1 598 | 2 079 | 4 962 | 9 404 | 9 826 | 8 086 |
| 189 977 | 275 295 | 25 954 | 30 302 | 24 578 | 18 687 | 53 688 | 46 251 |
| 100 050 | 90 845 | 24 605 | 11 400 | 4 830 | 2 931 | 10 809 | 7 667 |
| 213 | 34 506 | 1 105 | 52 816 | 1 088 | 94 773 | 437 235 | 68 378 |
| 1 178 395 | 1 919 603 | 251 937 | 135 728 | 160 441 | 72 965 | 319 813 | 191 920 |
| 21 980 | 30 854 | 4 337 | 1 945 | 777 | 574 | 921 | 4 737 |
| 68 902 | 180 542 | 24 763 | 13 422 | 21 747 | 12 290 | 30 224 | 27 734 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 13 070 804 | 13 656 992 | 2 781 230 | 1 785 996 | 2 173 897 | 1 937 560 | 4 642 028 | 3 862 289 |
| (120 283) | (293 790) | (22 233) | (17 969) | (39 941) | (29 733) | (76 489) | (93 426) |
| 0 | (136 255) | 0 | (5 887) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (192) | 0 | 0 | (8 117) | (2 856) | (30 524) | (5 696) | 0 |
| (2 021 670) | (2 481 720) | (394 267) | (202 456) | (287 563) | (132 585) | (576 267) | (325 573) |
| (8 457) | (32 381) | (3 826) | (188) | (778) | (2 607) | (6 207) | (3 628) |
| (5 770) | (5 738) | (948) | (605) | (606) | (735) | (1 299) | (1 447) |
| (7 828) | (4 154) | (108 032) | (75 928) | (618 014) | (261 713) | (1 556 968) | (796 152) |
| 0 | 0 | (36 861) | (75 925) | (24 686) | (79 599) | 0 | (9 519) |
| (262) | (339) | (188) | (124) | (1) | (2) | (36) | (51) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (7 188) | (6 988) | (2 767) | (692) | (527) | (446) | (1 105) | (2 363) |
| (85 679) | (82 017) | (10 054) | (13 852) | (9 704) | (18 182) | (16 758) | (35 345) |
| (99 753) | (75 269) | (31 847) | (14 363) | (12 169) | (17 059) | (20 110) | (22 923) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2 357 082) | (3 118 651) | (611 023) | (416 106) | (996 845) | (573 185) | (2 260 935) | (1 290 427) |
| \$ 10 713 722 | \$ 10 538 341 | \$ 2 170 207 | \$ 1 369 890 | \$ 1 177 052 | \$ 1 364 375 | \$ 2 381 093 | \$ 2 571 862 |

Bilan (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds Income Fund | | Fonds Income Fund II | |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 96 949 829 | \$ 67 246 471 | \$ 135 928 | \$ 56 970 |
| Fonds d'investissement | 1 805 212 | 2 081 428 | 123 | 1 740 |
| Contrats de mise en pension | 274 468 | 3 421 698 | 0 | 0 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 4 452 969 | 5 163 114 | 857 | 718 |
| Liquidités | 65 968 | 89 931 | 2 627 | 644 |
| Dépôts auprès de contreparties | 1 594 328 | 1 852 978 | 1 493 | 1 022 |
| Produits à recevoir | 463 626 | 354 824 | 900 | 384 |
| À recevoir sur investissements vendus | 26 720 | 60 282 | 5 | 5 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 24 623 052 | 21 347 671 | 18 950 | 8 075 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 217 821 | 88 371 | 14 089 | 4 020 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 1 889 968 | 1 235 828 | 1 853 | 637 |
| Autres actifs | 92 | 236 | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 132 364 053 | 102 942 832 | 176 825 | 74 215 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (3 184 989) | (3 649 860) | (360) | (406) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | (937 631) | (734 103) | (582) | 0 |
| À payer sur investissements achetés | (228 964) | (205 883) | (823) | (182) |
| À payer sur investissements achetés TBA | (53 120 749) | (37 310 306) | (43 381) | (15 917) |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (91 455) | (145 081) | (741) | 0 |
| Frais de gestion à payer | (55 002) | (45 253) | (123) | (48) |
| À payer sur contrats de prise en pension | (495) | (15 867) | 0 | 0 |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | 0 | (3 572) | 0 |
| Charges à payer | (4 542) | (4 925) | 0 | 0 |
| Découvert bancaire | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | (3 824) | (2 737) | 0 | 0 |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (2 987 747) | (2 473 835) | (1 793) | (1 036) |
| Dépôts des contreparties | (1 205 538) | (374 655) | (290) | 0 |
| Autres passifs | 0 | 0 | 0 | (3) |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (61 820 936) | (44 962 505) | (51 665) | (17 592) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 70 543 117 | \$ 57 980 327 | \$ 125 160 | \$ 56 623 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | | Fonds Low Average Duration Fund | | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | Fonds Low Duration Income Fund | |
|-------------------------------------|------------------------|------------------------------------|------------------------|--|------------------------|-----------------------------------|------------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| \$ 289 304 | \$ 320 121 | \$ 1 099 774 | \$ 1 235 606 | \$ 1 024 085 | \$ 691 422 | \$ 2 692 081 | \$ 1 213 608 |
| 28 256 | 68 975 | 82 593 | 85 631 | 16 247 | 643 | 199 001 | 106 140 |
| 364 | 40 720 | 100 744 | 956 | 678 | 1 604 | 345 484 | 98 831 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 9 713 | 14 716 | 3 586 | 7 284 | 8 563 | 13 518 | 77 338 | 79 359 |
| 1 667 | 0 | 2 008 | 2 692 | 892 | 390 | 7 667 | 6 374 |
| 6 470 | 8 179 | 9 047 | 24 403 | 11 190 | 10 136 | 47 017 | 34 272 |
| 462 | 688 | 7 935 | 6 394 | 10 372 | 5 082 | 11 731 | 7 264 |
| 1 236 | 13 | 257 005 | 723 | 0 | 202 | 426 | 2 215 |
| 67 319 | 10 546 | 239 895 | 380 707 | 102 013 | 69 997 | 988 905 | 367 632 |
| 59 | 100 | 647 | 976 | 834 | 2 763 | 14 906 | 2 070 |
| 7 218 | 7 201 | 8 585 | 7 914 | 3 456 | 11 170 | 31 081 | 21 540 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 412 068 | 471 259 | 1 811 819 | 1 753 286 | 1 178 330 | 806 927 | 4 415 637 | 1 939 305 |
| (14 826) | (10 695) | (7 795) | (14 403) | (5 543) | (11 395) | (48 681) | (64 082) |
| 0 | 0 | (50 185) | (76 949) | 0 | (14 029) | (5 624) | (5 209) |
| (80) | (2 206) | (41 000) | (2 924) | 0 | (1 062) | (99 442) | (9 219) |
| (117 222) | (43 111) | (323 595) | (427 587) | (174 185) | (97 540) | (2 128 585) | (724 143) |
| (988) | (1 769) | (627) | (1 987) | (1 818) | (422) | (2 117) | (185) |
| (267) | (445) | (380) | (495) | (417) | (289) | (976) | (565) |
| (15 063) | 0 | (525 595) | (144 857) | (6 973) | (12 776) | 0 | 0 |
| (1 229) | 0 | (44 279) | (4 077) | (4 817) | (1 409) | 0 | 0 |
| (3) | (5) | (187) | (10) | 0 | 0 | (24) | (24) |
| 0 | (980) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (16) | (13) | (44) | (20) | (600) | (247) |
| (4 899) | (6 644) | (4 015) | (3 315) | (4 533) | (4 014) | (54 022) | (28 430) |
| (4 243) | (2 326) | (4 300) | (3 911) | (7 157) | (9 222) | (45 261) | (22 821) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (158 820) | (68 181) | (1 001 974) | (680 528) | (205 487) | (152 178) | (2 385 332) | (854 925) |
| \$ 253 248 | \$ 403 078 | \$ 809 845 | \$ 1 072 758 | \$ 972 843 | \$ 654 749 | \$ 2 030 305 | \$ 1 084 380 |

Bilan (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds Low Duration Opportunities Fund | | Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | |
|--|--|------------------------|--|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 1 047 330 | \$ 1 216 746 | \$ 5 199 | \$ 5 070 |
| Fonds d'investissement | 70 798 | 133 056 | 0 | 0 |
| Contrats de mise en pension | 2 805 | 118 800 | 0 | 0 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 21 493 | 55 664 | 27 | 22 |
| Liquidités | 3 584 | 3 357 | 163 | 122 |
| Dépôts auprès de contreparties | 27 622 | 57 806 | 69 | 31 |
| Produits à recevoir | 5 531 | 7 718 | 37 | 16 |
| À recevoir sur investissements vendus | 22 | 12 795 | 0 | 0 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 494 771 | 282 511 | 466 | 274 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 28 | 542 | 0 | 0 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 32 067 | 45 871 | 61 | 51 |
| Autres actifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 1 706 051 | 1 934 866 | 6 022 | 5 586 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (33 847) | (109 833) | (57) | (67) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | (41 577) | (94 108) | (100) | 0 |
| À payer sur investissements achetés | (9) | (12 575) | 0 | 0 |
| À payer sur investissements achetés TBA | (796 267) | (347 541) | (624) | (545) |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (185) | (139) | 0 | 0 |
| Frais de gestion à payer | (311) | (542) | (2) | (2) |
| À payer sur contrats de prise en pension | (15 085) | 0 | 0 | 0 |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Charges à payer | (166) | (8) | 0 | 0 |
| Découvert bancaire | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | (313) | (1 377) | 0 | 0 |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (15 582) | (19 443) | (18) | (44) |
| Dépôts des contreparties | (15 085) | (3 519) | 0 | 0 |
| Autres passifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (918 427) | (589 085) | (801) | (658) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 787 624 | \$ 1 345 781 | \$ 5 221 | \$ 4 928 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | | Fonds Mortgage Opportunities Fund | | Fonds StocksPLUS™ Fund | | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | |
|--|---------------------|-----------------------------------|---------------------|------------------------|---------------------|---------------------------------|---------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| \$ 88 045 | \$ 106 959 | \$ 1 902 209 | \$ 1 724 999 | \$ 1 318 561 | \$ 711 694 | \$ 9 254 | \$ 7 750 |
| 9 668 | 11 833 | 4 | 23 | 179 118 | 92 742 | 1 042 | 904 |
| 631 | 811 | 68 968 | 17 318 | 544 588 | 156 445 | 1 095 | 1 374 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 264 | 1 447 | 16 817 | 44 003 | 25 961 | 12 661 | 295 | 258 |
| 98 | 552 | 300 | 167 | 4 397 | 2 178 | 22 | 11 |
| 970 | 2 870 | 13 878 | 11 602 | 57 022 | 85 945 | 389 | 861 |
| 36 | 104 | 5 108 | 4 660 | 6 425 | 2 660 | 23 | 21 |
| 351 | 13 | 0 | 1 901 | 61 217 | 255 | 433 | 0 |
| 0 | 0 | 2 175 726 | 1 781 393 | 162 621 | 0 | 3 816 | 1 240 |
| 36 | 59 | 866 | 412 | 2 442 | 1 226 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 12 095 | 17 755 | 10 848 | 33 144 | 559 | 115 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 100 099 | 124 648 | 4 195 971 | 3 604 233 | 2 373 200 | 1 098 950 | 16 928 | 12 534 |
| (296) | (237) | (13 734) | (17 225) | (17 262) | (30 319) | (323) | (293) |
| 0 | 0 | (432 300) | (518 212) | 0 | 0 | 0 | (583) |
| (963) | (2 379) | (39 100) | (194 452) | (52 179) | (37 060) | 0 | (583) |
| 0 | 0 | (2 702 052) | (1 654 287) | (243 902) | 0 | (4 496) | (1 310) |
| (119) | (834) | (669) | (596) | (2 282) | (1 097) | 0 | 0 |
| (90) | (109) | (585) | (547) | (1 153) | (656) | (7) | (6) |
| 0 | 0 | (55 855) | (316 493) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (823) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (8) | (8) | (13) | (5) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (48) | (21) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (5 796) | (18 210) | (31 885) | (15 583) | (637) | (231) |
| (138) | (952) | (19 745) | (35 034) | (61 536) | (5 491) | (290) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1 606) | (4 511) | (3 270 715) | (2 755 085) | (410 212) | (90 211) | (5 753) | (3 006) |
| \$ 98 493 | \$ 120 137 | \$ 925 256 | \$ 849 148 | \$ 1 962 988 | \$ 1 008 739 | \$ 11 175 | \$ 9 528 |

Bilan (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds Strategic Income Fund | | Fonds Total Return Bond Fund | |
|--|--------------------------------|------------------------|---------------------------------|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| Actif à court terme : | | | | |
| Actif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 654 744 | \$ 610 560 | \$ 5 908 989 | \$ 4 770 861 |
| Fonds d'investissement | 179 | 29 661 | 151 381 | 292 421 |
| Contrats de mise en pension | 605 | 781 | 732 | 170 895 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 38 858 | 53 205 | 60 519 | 110 789 |
| Liquidités | 2 419 | 4 623 | 12 041 | 15 733 |
| Dépôts auprès de contreparties | 8 906 | 11 922 | 63 287 | 120 293 |
| Produits à recevoir | 3 085 | 2 787 | 33 067 | 25 541 |
| À recevoir sur investissements vendus | 65 | 4 738 | 80 | 51 883 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 154 850 | 224 967 | 2 343 513 | 2 180 028 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 315 | 385 | 6 409 | 12 045 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 17 307 | 14 864 | 58 602 | 77 114 |
| Autres actifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 881 333 | 958 493 | 8 638 620 | 7 827 603 |
| Passif à court terme : | | | | |
| Passif financier à la juste valeur par résultat : | | | | |
| Instruments financiers dérivés | (33 040) | (36 766) | (81 227) | (106 644) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | (13 890) | (13 092) | (34 262) | (68 457) |
| À payer sur investissements achetés | (8) | (741) | (81) | (6 344) |
| À payer sur investissements achetés TBA | (319 259) | (367 853) | (3 960 404) | (3 304 650) |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (579) | (539) | (6 899) | (3 734) |
| Frais de gestion à payer | (501) | (585) | (2 720) | (2 652) |
| À payer sur contrats de prise en pension | (33 125) | 0 | (3 246) | (1 745) |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (1 037) | 0 | 0 | (76 810) |
| Charges à payer | (131) | (17) | (206) | (210) |
| Découvert bancaire | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | 0 | 0 | (143) | (186) |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (21 991) | (21 409) | (25 978) | (72 167) |
| Dépôts des contreparties | (7 823) | (10 934) | (103 403) | (33 287) |
| Autres passifs | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (431 384) | (451 936) | (4 218 569) | (3 676 886) |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 449 949 | \$ 506 557 | \$ 4 420 051 | \$ 4 150 717 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | Fonds UK Corporate Bond Fund | | Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | Fonds US High Yield Bond Fund | |
|---|------------------------|---------------------------------|------------------------|---|------------------------|----------------------------------|------------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| \$ 203 304 | \$ 335 879 | £ 365 325 | £ 372 745 | £ 330 293 | £ 309 110 | \$ 1 770 912 | \$ 1 895 465 |
| 23 640 | 41 693 | 18 137 | 5 370 | 0 | 0 | 74 138 | 39 162 |
| 18 466 | 27 452 | 5 455 | 177 | 6 500 | 269 | 912 | 9 269 |
| 0 | 600 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 63 061 | 42 556 | 2 225 | 4 161 | 6 669 | 8 017 | 10 460 | 12 684 |
| 4 102 | 3 994 | 1 280 | 1 084 | 1 177 | 0 | 1 581 | 550 |
| 26 538 | 28 858 | 3 382 | 7 199 | 3 694 | 14 086 | 18 827 | 10 449 |
| 1 340 | 1 601 | 5 404 | 4 405 | 5 519 | 4 594 | 29 726 | 31 884 |
| 208 | 134 | 57 | 1 522 | 0 | 0 | 111 | 3 204 |
| 12 700 | 25 221 | 19 621 | 0 | 25 877 | 0 | 0 | 0 |
| 97 | 11 015 | 137 | 61 | 0 | 0 | 1 577 | 1 390 |
| 19 620 | 17 270 | 6 788 | 7 000 | 1 024 | 15 391 | 3 338 | 270 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 186 |
| 373 076 | 536 273 | 427 811 | 403 724 | 380 753 | 351 467 | 1 911 582 | 2 004 513 |
| (66 665) | (44 109) | (2 583) | (1 718) | (841) | (3 697) | (4 499) | (1 517) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (203) | (523) | (1 403) | 0 | (67) | 0 | (13 824) | (4 262) |
| (42 429) | (30 301) | (33 437) | 0 | (43 049) | 0 | 0 | 0 |
| (81) | (3 552) | (524) | (70) | (4) | 0 | (3 060) | (2 743) |
| (242) | (453) | (106) | (127) | (123) | (131) | (1 080) | (1 173) |
| 0 | 0 | (20 592) | 0 | (3 946) | 0 | (8 200) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (17) | (148) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (2 154) | 0 | 0 |
| (528) | (317) | (1 838) | (1 865) | (393) | (371) | (42) | (20) |
| (16 727) | (16 064) | (5 857) | (10 440) | (6 722) | (19 583) | (4 851) | (1 779) |
| (5 854) | (5 030) | (410) | (331) | (840) | (511) | (3 122) | (7 949) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (132 730) | (100 349) | (66 750) | (14 551) | (55 985) | (26 447) | (38 695) | (19 591) |
| \$ 240 346 | \$ 435 924 | £ 361 061 | £ 389 173 | £ 324 768 | £ 325 020 | \$ 1 872 887 | \$ 1 984 922 |

Bilan (suite)

(Montants en milliers)

**Fonds US Investment Grade
Corporate Bond Fund**

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|------------------------|------------------------|
|--|------------------------|------------------------|

Actif à court terme :

Actif financier à la juste valeur par résultat :

| | | |
|--|----------------|----------------|
| Valeurs mobilières | \$ 487 346 | \$ 346 399 |
| Fonds d'investissement | 18 239 | 38 657 |
| Contrats de mise en pension | 259 | 15 383 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 |
| Instruments financiers dérivés | 7 317 | 8 390 |
| Liquidités | 680 | 796 |
| Dépôts auprès de contreparties | 8 358 | 12 615 |
| Produits à recevoir | 5 209 | 3 400 |
| À recevoir sur investissements vendus | 8 | 27 549 |
| À recevoir sur investissements vendus TBA | 62 254 | 21 983 |
| À recevoir sur actions du Fonds vendues | 759 | 2 561 |
| À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | 2 128 | 5 621 |
| Autres actifs | 0 | 0 |
| Total de l'actif à court terme | 592 557 | 483 354 |

Passif à court terme :

Passif financier à la juste valeur par résultat :

| | | |
|--|------------------|-----------------|
| Instruments financiers dérivés | (1 161) | (7 500) |
| Juste valeur des titres vendus à découvert | 0 | (2 035) |
| À payer sur investissements achetés | (8) | 0 |
| À payer sur investissements achetés TBA | (100 772) | (39 829) |
| À payer sur actions du Fonds rachetées | (128) | (58) |
| Frais de gestion à payer | (235) | (182) |
| À payer sur contrats de prise en pension | 0 | 0 |
| À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | 0 | (38 655) |
| Charges à payer | 0 | 0 |
| Découvert bancaire | 0 | 0 |
| Dividendes à payer | (394) | (156) |
| À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés | (7 154) | (4 541) |
| Dépôts des contreparties | (1 844) | (1 876) |
| Autres passifs | 0 | 0 |
| Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | (111 696) | (94 832) |

| | | |
|---|-------------------|-------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables | \$ 480 861 | \$ 388 522 |
|---|-------------------|-------------------|

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

* Le Total Société au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 a été ajusté pour éliminer les investissements croisés et les soldes au nom de la Société. Veuillez vous reporter à la Note 14 dans les Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

Au nom du Conseil d'administration :

Administrateur : Craig A. Dawson

Administrateur : David M. Kennedy

Date : 25 avril 2024

| Fonds US Short-Term Fund | | Total Société* | |
|--------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
| \$ 1 683 085 | \$ 1 891 711 | \$ 200 471 776 | \$ 158 067 452 |
| 184 482 | 226 018 | 6 375 691 | 7 205 963 |
| 4 561 | 154 472 | 5 072 632 | 10 455 165 |
| 0 | 0 | 162 529 | 11 759 |
| 716 | 10 584 | 7 073 805 | 8 087 908 |
| 1 292 | 1 993 | 363 899 | 369 095 |
| 12 558 | 18 130 | 3 986 039 | 4 738 366 |
| 13 665 | 12 016 | 1 328 589 | 1 097 303 |
| 314 | 4 313 | 1 479 653 | 1 035 370 |
| 0 | 0 | 48 619 873 | 36 037 151 |
| 6 660 | 6 106 | 416 969 | 405 829 |
| 7 819 | 5 389 | 3 338 437 | 3 520 113 |
| 0 | 0 | 351 | 662 |
| 1 915 152 | 2 330 732 | 278 690 243 | 231 032 136 |
| (8 435) | (5 824) | (5 397 203) | (7 088 064) |
| 0 | 0 | (2 950 061) | (2 699 152) |
| 0 | (1 430) | (1 786 064) | (3 353 495) |
| 0 | 0 | (91 155 892) | (57 317 614) |
| (5 085) | (2 669) | (246 185) | (417 932) |
| (583) | (722) | (115 314) | (108 234) |
| 0 | 0 | (4 637 552) | (2 874 391) |
| (43 894) | 0 | (217 863) | (303 953) |
| (2) | (4) | (8 387) | (7 630) |
| 0 | 0 | (1 140) | (20 563) |
| 0 | 0 | (31 351) | (30 796) |
| (2 187) | (4 603) | (4 700 999) | (4 103 580) |
| (760) | (5 365) | (2 339 615) | (1 182 210) |
| 0 | 0 | (62) | (3) |
| (60 946) | (20 617) | (113 587 688) | (79 507 617) |
| \$ 1 854 206 | \$ 2 310 115 | \$ 165 102 555 | \$ 151 524 519 |

Compte de résultat

| (Montants en milliers) | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | |
|---|---------------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 240 534 | \$ 215 235 | \$ 17 723 | \$ 15 190 |
| Autres produits | 0 | 0 | 65 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (398 489) | (437 831) | (39 020) | (25 277) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | 23 335 | (75 534) | 1 905 | (12 295) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | 1 147 | 333 | 96 | 152 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 179 674 | (288 652) | 28 190 | (26 718) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | (20 137) | 15 038 | (2 175) | 2 022 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | 82 | (22) | 6 | 0 |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 26 146 | (571 433) | 6 790 | (46 926) |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (18 191) | (19 675) | (1 738) | (1 966) |
| Frais de services | (255) | (570) | 0 | 0 |
| Frais de commercialisation | (126) | (167) | 0 | 0 |
| Autres charges | (4) | (3) | 0 | 0 |
| Total des charges | (18 576) | (20 415) | (1 738) | (1 966) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 17 | 17 | 4 | 4 |
| Charges d'exploitation nettes | (18 559) | (20 398) | (1 734) | (1 962) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 7 587 | (591 831) | 5 056 | (48 888) |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (224) | (165) | (42) | (17) |
| Frais de facilité de crédit | (182) | 0 | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | (31 183) | (42 838) | (8 398) | (7 980) |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | (586) | (557) | (1 093) | (49) |
| Total des frais financiers | (32 175) | (43 560) | (9 533) | (8 046) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | (24 588) | (635 391) | (4 477) | (56 934) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (29) | 23 | (2) | 3 |
| Impôt sur les plus-values | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | (24 617) | (635 368) | (4 479) | (56 931) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ (24 617) | \$ (635 368) | \$ (4 479) | \$ (56 931) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

⁽¹⁾ Le Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund a été renommé Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund le 29 novembre 2023.

| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund ⁽¹⁾ | | Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | Fonds PIMCO Climate Bond Fund | | Fonds Commodity Real Return Fund | |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 25 321 | \$ 15 505 | \$ 337 190 | \$ 321 673 | \$ 9 277 | \$ 6 811 | \$ 39 408 | \$ 118 558 |
| 729 | 0 | 15 | 0 | 0 | 0 | 68 | 0 |
| (28 078) | (53 006) | (652 021) | (339 637) | (16 329) | (21 894) | (60 310) | (70 911) |
| 57 818 | (108 236) | (4 525) | 281 327 | 319 | (3 655) | (139 912) | 302 706 |
| (1 834) | (849) | (22 530) | (92 745) | (22) | (3) | (388) | (8 645) |
| 23 487 | (30 206) | 875 084 | (1 370 283) | 36 903 | (49 332) | 100 823 | (183 928) |
| 10 772 | (34 286) | (23 075) | 9 513 | (2 505) | (1 924) | (8 141) | (59 310) |
| (654) | 567 | 466 | 473 | 23 | 35 | (653) | 701 |
| 87 561 | (210 511) | 510 604 | (1 189 679) | 27 666 | (69 962) | (69 105) | 99 171 |
| (9 476) | (10 327) | (52 909) | (63 252) | (1 638) | (1 683) | (11 156) | (18 878) |
| (37) | (31) | (1 039) | (1 606) | 0 | (9) | (113) | (252) |
| 0 | 0 | (1 176) | (1 243) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1) | (2) | (573) | (656) | (11) | (15) | (1) | (2) |
| (9 514) | (10 360) | (55 697) | (66 757) | (1 649) | (1 707) | (11 270) | (19 132) |
| 327 | 352 | 0 | 302 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (9 187) | (10 008) | (55 697) | (66 455) | (1 649) | (1 707) | (11 270) | (19 132) |
| 78 374 | (220 519) | 454 907 | (1 256 134) | 26 017 | (71 669) | (80 375) | 80 039 |
| (479) | (235) | (18 823) | (10 267) | (8) | (6) | (18 977) | (6 180) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2 909) | (2 897) | (76 063) | (84 957) | (3 580) | (2 206) | (712) | (336) |
| (4) | (516) | (3 230) | (2 829) | (33) | 40 | (24) | 41 |
| (3 392) | (3 648) | (98 116) | (98 053) | (3 621) | (2 172) | (19 713) | (6 475) |
| 74 982 | (224 167) | 356 791 | (1 354 187) | 22 396 | (73 841) | (100 088) | 73 564 |
| (982) | (721) | (12) | (609) | (5) | 3 | 1 | 0 |
| (41) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 73 959 | (224 888) | 356 779 | (1 354 796) | 22 391 | (73 838) | (100 087) | 73 564 |
| \$ 73 959 | \$ (224 888) | \$ 356 779 | \$ (1 354 796) | \$ 22 391 | \$ (73 838) | \$ (100 087) | \$ 73 564 |

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | Fonds Diversified Income Fund | |
|--|---|--|--|--|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 5 811 | \$ 4 895 | \$ 4 117 377 | \$ 4 235 503 |
| Autres produits | 65 | 0 | 1 915 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (1 626) | (5 524) | (479 821) | (732 205) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | 1 275 | (2 140) | 10 883 | (1 031 422) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | (48) | (53) | (48 678) | (127 348) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 5 126 | (9 050) | 821 317 | (1 569 253) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | (248) | 350 | 125 129 | (137 498) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | 6 | (9) | (236) | (2 364) |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 10 361 | (11 531) | 842 246 | (3 176 587) |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (1 056) | (1 271) | (85 385) | (117 086) |
| Frais de services | 0 | 0 | (602) | (575) |
| Frais de commercialisation | 0 | 0 | (712) | (945) |
| Autres charges | (2) | (3) | (753) | (488) |
| Total des charges | (1 058) | (1 274) | (87 452) | (119 094) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 1 | 1 | 937 | 1 707 |
| Charges d'exploitation nettes | (1 057) | (1 273) | (86 515) | (117 387) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 9 304 | (12 804) | 755 731 | (3 293 974) |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (56) | (155) | (4 384) | (520) |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | 0 | 0 | (121 740) | (139 762) |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | 0 | 0 | (3 769) | (5 667) |
| Total des frais financiers | (56) | (155) | (129 893) | (145 949) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 9 248 | (12 959) | 625 838 | (3 439 923) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (4) | 5 | 9 | 175 |
| Impôt sur les plus-values | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 9 244 | (12 954) | 625 847 | (3 439 748) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ 9 244 | \$ (12 954) | \$ 625 847 | \$ (3 439 748) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | | Fonds Diversified Income ESG Fund | | Fonds Dynamic Bond Fund | | Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | |
|---|-----------------------------------|-----------------------------------|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Période du 27 juillet 2022 au 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 25 508 | \$ 32 188 | \$ 2 228 | \$ 226 | \$ 174 261 | \$ 97 066 | € 112 566 | € 54 199 |
| 197 | 0 | 0 | 0 | 2 045 | 0 | 0 | 0 |
| (36 982) | (78 712) | (151) | 12 | (23 502) | (49 022) | (318 591) | (10 017) |
| 15 893 | (20 394) | (604) | (135) | 95 665 | (160 148) | (172 340) | (164 295) |
| 567 | (3 436) | (292) | 15 | (20 876) | (14 875) | 3 446 | 21 614 |
| 54 192 | (92 998) | 1 983 | (176) | 126 102 | (262 668) | 269 114 | (805 632) |
| 3 446 | (15 985) | 215 | (13) | 42 245 | (63 001) | 68 637 | 5 000 |
| 57 | (189) | 3 | 2 | 813 | (254) | 33 663 | (7 889) |
| 62 878 | (179 526) | 3 382 | (69) | 396 753 | (452 902) | (3 505) | (907 020) |
| (4 625) | (7 323) | (299) | (30) | (32 256) | (29 354) | (52 945) | (78 669) |
| (18) | (27) | 0 | 0 | (166) | (197) | (35) | (38) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (118) | (178) | 0 | 0 |
| (25) | (11) | (2) | 0 | (168) | (147) | (336) | (395) |
| (4 668) | (7 361) | (301) | (30) | (32 708) | (29 876) | (53 316) | (79 102) |
| 2 | 94 | 0 | 0 | 452 | 462 | 916 | 1 243 |
| (4 666) | (7 267) | (301) | (30) | (32 256) | (29 414) | (52 400) | (77 859) |
| 58 212 | (186 793) | 3 081 | (99) | 364 497 | (482 316) | (55 905) | (984 879) |
| (221) | (82) | 0 | 0 | (1 666) | (482) | (1 825) | (354) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (9 001) | (9 289) | 0 | 0 | (9 304) | (7 206) | (5 496) | (6 983) |
| 103 | (645) | 0 | 0 | (96) | (584) | 9 | 555 |
| (9 119) | (10 016) | 0 | 0 | (11 066) | (8 272) | (7 312) | (6 782) |
| 49 093 | (196 809) | 3 081 | (99) | 353 431 | (490 588) | (63 217) | (991 661) |
| 0 | 12 | (5) | (1) | (62) | 12 | (3 111) | (10 191) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (617) | (41) | 0 | 0 |
| 49 093 | (196 797) | 3 076 | (100) | 352 752 | (490 617) | (66 328) | (1 001 852) |
| \$ 49 093 | \$ (196 797) | \$ 3 076 | \$ (100) | \$ 352 752 | \$ (490 617) | € (66 328) | € (1 001 852) |

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds Emerging Local Bond Fund | | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | |
|---|--|--|--|--|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Période du 27 juillet 2022 au 31 décembre 2022 |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 182 687 | \$ 110 813 | \$ 879 | \$ 151 |
| Autres produits | 514 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (66 925) | (295 703) | 134 | 4 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | 73 006 | 64 889 | 235 | 73 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | 7 475 | (13 501) | 33 | (13) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 212 424 | 18 064 | 2 752 | 151 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | 10 774 | (19 913) | 422 | 62 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | (15 024) | 488 | 16 | 1 |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 404 931 | (134 863) | 4 471 | 429 |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (24 014) | (18 109) | (110) | (20) |
| Frais de services | (52) | (95) | 0 | 0 |
| Frais de commercialisation | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Autres charges | (3) | (3) | (1) | 0 |
| Total des charges | (24 069) | (18 207) | (111) | (20) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Charges d'exploitation nettes | (24 069) | (18 207) | (111) | (20) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 380 862 | (153 070) | 4 360 | 409 |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (12 909) | (6 817) | (30) | 0 |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | (16 256) | (11 526) | (4) | (1) |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | 264 | 95 | (1) | 0 |
| Total des frais financiers | (28 901) | (18 248) | (35) | (1) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 351 961 | (171 318) | 4 325 | 408 |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (1 835) | (681) | (33) | (4) |
| Impôt sur les plus-values | (914) | (201) | (21) | (2) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 349 212 | (172 200) | 4 271 | 402 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ 349 212 | \$(172 200) | \$ 4 271 | \$ 402 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

| Fonds Emerging Markets Bond Fund | | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | | Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | |
|--------------------------------------|--------------------------------------|---|--------------------------------------|---|--------------------------------------|--|--------------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 230 979 | \$ 190 399 | \$ 153 857 | \$ 120 478 | \$ 8 637 | \$ 7 612 | \$ 12 020 | \$ 9 073 |
| 1 306 | 0 | 0 | 0 | 274 | 0 | 0 | 0 |
| (117 785) | (411 715) | (135 800) | (132 949) | (10 598) | (10 629) | (14 456) | (34 162) |
| 4 964 | (197 333) | 26 172 | (169 322) | 5 550 | (12 531) | 14 250 | (446) |
| 1 954 | (5 189) | (295) | (2 769) | (76) | (101) | (427) | 410 |
| 317 481 | (486 975) | 274 519 | (496 113) | 12 923 | (25 227) | 16 877 | (11 867) |
| 4 407 | 6 524 | (7 160) | 23 079 | (2 724) | 2 628 | (687) | (811) |
| (268) | (79) | (3 116) | (644) | 11 | 5 | (26) | 24 |
| 443 038 | (904 368) | 308 177 | (658 240) | 13 997 | (38 243) | 27 551 | (37 779) |
| (30 246) | (31 503) | (22 835) | (21 416) | (1 941) | (2 073) | (934) | (1 565) |
| (26) | (30) | (10) | (8) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (119) | (146) | (5) | (6) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (9) | (5) | (11) | (3) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (30 400) | (31 684) | (22 861) | (21 433) | (1 941) | (2 073) | (934) | (1 565) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 2 | 2 |
| (30 400) | (31 684) | (22 861) | (21 433) | (1 941) | (2 073) | (932) | (1 563) |
| 412 638 | (936 052) | 285 316 | (679 673) | 12 056 | (40 316) | 26 619 | (39 342) |
| (7 664) | (2 019) | (3 648) | (719) | (52) | (18) | (301) | (9) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (42 330) | (45 471) | (28 649) | (28 379) | 0 | 0 | (53) | (20) |
| 690 | (690) | (798) | 482 | 0 | 0 | 0 | (1) |
| (49 304) | (48 180) | (33 095) | (28 616) | (52) | (18) | (354) | (30) |
| 363 334 | (984 232) | 252 221 | (708 289) | 12 004 | (40 334) | 26 265 | (39 372) |
| (370) | (171) | (255) | 24 | (17) | (3) | (77) | (78) |
| (76) | 0 | (52) | 0 | (3) | 0 | 6 | (2) |
| 362 888 | (984 403) | 251 914 | (708 265) | 11 984 | (40 337) | 26 194 | (39 452) |
| \$ 362 888 | \$ (984 403) | \$ 251 914 | \$ (708 265) | \$ 11 984 | \$ (40 337) | \$ 26 194 | \$ (39 452) |

Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | Fonds PIMCO ESG Income Fund | |
|---|--|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 1 143 | \$ 630 | \$ 12 268 | \$ 4 921 |
| Autres produits | 144 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (215) | (1 875) | (3 871) | (1 520) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | 665 | 296 | 431 | (1 583) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | 75 | 32 | 616 | (62) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 820 | (922) | 10 748 | (20 930) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | (464) | 480 | 327 | 91 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | (4) | (16) | 82 | (46) |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 2 164 | (1 375) | 20 601 | (19 129) |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (296) | (361) | (1 632) | (1 005) |
| Frais de services | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de commercialisation | 0 | 0 | (39) | (4) |
| Autres charges | 0 | 0 | (12) | (8) |
| Total des charges | (296) | (361) | (1 683) | (1 017) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 6 | 7 | 0 | 0 |
| Charges d'exploitation nettes | (290) | (354) | (1 683) | (1 017) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 1 874 | (1 729) | 18 918 | (20 146) |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (15) | (5) | (261) | 0 |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | 0 | 0 | (3 339) | (1 282) |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | 0 | 0 | 193 | 40 |
| Total des frais financiers | (15) | (5) | (3 407) | (1 242) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 1 859 | (1 734) | 15 511 | (21 388) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (4) | (3) | (94) | (9) |
| Impôt sur les plus-values | 1 | 0 | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 1 856 | (1 737) | 15 417 | (21 397) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ 1 856 | \$ (1 737) | \$ 15 417 | \$ (21 397) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

| Fonds Euro Bond Fund | | Fonds Euro Credit Fund | | Fonds Euro Income Bond Fund | | Fonds Euro Long Average Duration Fund | |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| € 49 273 | € 33 483 | € 17 331 | € 12 380 | € 47 773 | € 40 277 | € 12 247 | € 1 889 |
| 359 | 0 | 17 | 0 | 12 | 0 | 62 | 0 |
| (127 635) | (99 204) | (31 148) | (37 541) | (76 420) | (93 499) | (26 211) | (7 406) |
| (2 508) | (79 983) | 3 702 | (74 566) | 10 779 | (26 595) | (16 677) | (10 447) |
| 5 432 | 423 | 728 | 2 974 | (6 071) | 9 992 | (161) | (10) |
| 135 817 | (209 845) | 57 872 | (64 593) | 99 838 | (166 879) | 51 871 | (32 163) |
| 89 992 | (36 654) | 4 495 | (2 141) | 23 333 | (14 850) | 25 783 | (10 591) |
| 748 | 2 140 | (41) | 711 | 17 883 | 2 773 | 1 379 | 150 |
| 151 478 | (389 640) | 52 956 | (162 776) | 117 127 | (248 781) | 48 293 | (58 578) |
| (9 458) | (11 086) | (2 919) | (3 957) | (14 616) | (18 349) | (1 700) | (597) |
| (63) | (66) | 0 | 0 | (69) | (73) | 0 | 0 |
| 0 | (9) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (19) | (3) | (1) | (1) | (195) | (156) | 0 | 0 |
| (9 540) | (11 164) | (2 920) | (3 958) | (14 880) | (18 578) | (1 700) | (597) |
| 605 | 625 | 157 | 179 | 391 | 313 | 56 | 17 |
| (8 935) | (10 539) | (2 763) | (3 779) | (14 489) | (18 265) | (1 644) | (580) |
| 142 543 | (400 179) | 50 193 | (166 555) | 102 638 | (267 046) | 46 649 | (59 158) |
| (412) | (204) | (219) | (179) | (689) | (102) | (179) | (14) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1 143) | (969) | (379) | (1 172) | (14 822) | (14 923) | 0 | 0 |
| (57) | 7 | (38) | (99) | (26) | (1 288) | 0 | 0 |
| (1 612) | (1 166) | (636) | (1 450) | (15 537) | (16 313) | (179) | (14) |
| 140 931 | (401 345) | 49 557 | (168 005) | 87 101 | (283 359) | 46 470 | (59 172) |
| (91) | (2) | 0 | 4 | 1 | 4 | (27) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 140 840 | (401 347) | 49 557 | (168 001) | 87 102 | (283 355) | 46 443 | (59 172) |
| € 140 840 | € (401 347) | € 49 557 | € (168 001) | € 87 102 | € (283 355) | € 46 443 | € (59 172) |

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)

| | Fonds Euro Short-Term Fund | | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | € 7 372 | € 5 127 | € 13 685 | € 6 062 |
| Autres produits | 12 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (4 406) | (11 983) | (6 765) | (4 104) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | 3 059 | 8 148 | 2 707 | (2 508) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | (215) | 1 505 | 159 | 192 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 7 990 | (12 596) | 23 354 | (16 840) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | (3 920) | 3 715 | 2 633 | 1 089 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | 162 | (257) | (47) | 38 |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 10 054 | (6 341) | 35 726 | (16 071) |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (797) | (1 714) | (698) | (54) |
| Frais de services | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de commercialisation | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Autres charges | 0 | (1) | (6) | 0 |
| Total des charges | (797) | (1 715) | (704) | (54) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 0 | 0 | 46 | 28 |
| Charges d'exploitation nettes | (797) | (1 715) | (658) | (26) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 9 257 | (8 056) | 35 068 | (16 097) |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (25) | (84) | (24) | (33) |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total des frais financiers | (25) | (84) | (24) | (33) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 9 232 | (8 140) | 35 044 | (16 130) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (2) | (6) | 0 | 0 |
| Impôt sur les plus-values | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 9 230 | (8 146) | 35 044 | (16 130) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | € 9 230 | € (8 146) | € 35 044 | € (16 130) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | | Fonds Global Advantage Fund | | Fonds Global Bond Fund | | Fonds Global Bond ESG Fund | |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| € 5 406 | € 5 046 | \$ 15 702 | \$ 19 358 | \$ 366 989 | \$ 280 279 | \$ 107 374 | \$ 45 557 |
| 2 | 0 | 167 | 0 | 3 704 | 0 | 0 | 0 |
| (9 385) | (22 144) | (13 630) | (15 302) | (437 741) | (472 968) | (72 539) | (191 964) |
| 1 733 | 20 693 | 6 847 | (16 446) | 282 536 | 64 670 | 35 682 | (1 708) |
| 163 | 383 | (38) | (143) | (69 520) | (37 039) | 132 | (6 537) |
| 12 182 | (16 574) | 28 378 | (65 430) | 615 232 | (1 518 236) | 102 932 | (179 201) |
| (3 611) | 2 641 | 2 302 | 2 911 | 329 829 | (349 556) | 128 516 | (74 875) |
| 237 | 123 | (304) | (46) | (8 718) | 3 275 | (1 905) | 1 827 |
| 6 727 | (9 832) | 39 424 | (75 098) | 1 082 311 | (2 029 575) | 300 192 | (406 901) |
| (657) | (1 114) | (2 934) | (3 204) | (75 151) | (73 778) | (16 187) | (11 828) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (1 629) | (1 350) | (38) | (38) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (122) | (118) | (5) | (3) |
| (6) | 0 | (11) | (7) | (158) | (149) | (4) | (3) |
| (663) | (1 114) | (2 945) | (3 211) | (77 060) | (75 395) | (16 234) | (11 872) |
| 47 | 90 | 0 | 0 | 2 817 | 3 016 | 0 | 0 |
| (616) | (1 024) | (2 945) | (3 211) | (74 243) | (72 379) | (16 234) | (11 872) |
| 6 111 | (10 856) | 36 479 | (78 309) | 1 008 068 | (2 101 954) | 283 958 | (418 773) |
| (29) | (52) | (590) | (311) | (7 095) | (1 977) | (2 164) | (463) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (4 221) | (3 851) | (32 992) | (28 813) | (13 441) | (7 667) |
| 0 | 0 | 0 | 19 | 618 | 2 479 | (362) | 624 |
| (29) | (52) | (4 811) | (4 143) | (39 469) | (28 311) | (15 967) | (7 506) |
| 6 082 | (10 908) | 31 668 | (82 452) | 968 599 | (2 130 265) | 267 991 | (426 279) |
| (10) | (1) | (12) | (28) | (1 008) | (366) | (720) | (45) |
| 0 | 0 | (4) | 4 | 9 | (9) | 0 | 0 |
| 6 072 | (10 909) | 31 652 | (82 476) | 967 600 | (2 130 640) | 267 271 | (426 324) |
| € 6 072 | € (10 909) | \$ 31 652 | \$ (82 476) | \$ 967 600 | \$ (2 130 640) | \$ 267 271 | \$ (426 324) |

Compte de résultat (suite)

| | Fonds Global Bond Ex-US Fund | | Fonds Global High Yield Bond Fund | |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| (Montants en milliers) | | | | |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 21 891 | \$ 18 377 | \$ 169 394 | \$ 188 614 |
| Autres produits | 286 | 0 | 999 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (20 413) | (26 490) | (189 918) | (169 761) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | 15 144 | 36 891 | 39 818 | (171 171) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | (1 482) | (2 783) | (1 037) | (11 131) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 33 442 | (98 263) | 404 787 | (601 507) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | 26 187 | (19 836) | (6 554) | (8 034) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | (856) | 820 | (762) | 432 |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 74 199 | (91 284) | 416 727 | (772 558) |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (4 099) | (4 332) | (22 037) | (27 465) |
| Frais de services | (23) | (29) | (30) | (59) |
| Frais de commercialisation | (51) | (57) | (232) | (335) |
| Autres charges | (11) | (4) | (81) | (62) |
| Total des charges | (4 184) | (4 422) | (22 380) | (27 921) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 1 | 2 | 0 | 0 |
| Charges d'exploitation nettes | (4 183) | (4 420) | (22 380) | (27 921) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 70 016 | (95 704) | 394 347 | (800 479) |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (456) | (268) | (998) | (436) |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 | (673) | (704) |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | (2 446) | (1 708) | (50 569) | (60 236) |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | 16 | (133) | 215 | (866) |
| Total des frais financiers | (2 886) | (2 109) | (52 025) | (62 242) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 67 130 | (97 813) | 342 322 | (862 721) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (65) | (10) | 0 | 0 |
| Impôt sur les plus-values | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 67 065 | (97 823) | 342 322 | (862 721) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ 67 065 | \$ (97 823) | \$ 342 322 | \$ (862 721) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | Fonds Global Low Duration Real Return Fund | | Fonds Global Real Return Fund | |
|--|--------------------------------------|--|--------------------------------------|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 432 793 | \$ 390 373 | \$ 74 378 | \$ 38 525 | \$ 56 203 | \$ 88 002 | \$ 83 713 | \$ 281 845 |
| 3 979 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 734 | 0 |
| (634 780) | (661 979) | (59 556) | (94 471) | (32 996) | (45 666) | (101 995) | (335 981) |
| 65 395 | (643 008) | 25 153 | (58 018) | 40 846 | 14 927 | 46 010 | 206 342 |
| (5 486) | (47 103) | 5 453 | (6 533) | (642) | (5 085) | (5 486) | (30 133) |
| 1 090 196 | (1 965 880) | 154 912 | (242 999) | 82 088 | (130 314) | 223 714 | (810 716) |
| 153 446 | (65 555) | (2 609) | 7 204 | (32 799) | 14 994 | (38 176) | 862 |
| (4 852) | 3 046 | (37) | 327 | (176) | (113) | (1 821) | (1 087) |
| 1 100 691 | (2 990 106) | 197 694 | (355 965) | 112 524 | (63 255) | 207 693 | (688 868) |
| (69 518) | (75 989) | (9 272) | (6 912) | (8 133) | (7 358) | (15 905) | (19 357) |
| (2 139) | (2 500) | (1) | (1) | (22) | (24) | (280) | (434) |
| (1 114) | (1 462) | (1 757) | (1 331) | 0 | 0 | (196) | (283) |
| (156) | (154) | (2) | (1) | (2) | (1) | (3) | (4) |
| (72 927) | (80 105) | (11 032) | (8 245) | (8 157) | (7 383) | (16 384) | (20 078) |
| 898 | 900 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (72 029) | (79 205) | (11 032) | (8 245) | (8 157) | (7 383) | (16 384) | (20 078) |
| 1 028 662 | (3 069 311) | 186 662 | (364 210) | 104 367 | (70 638) | 191 309 | (708 946) |
| (2 092) | (2 270) | (7 379) | (1 223) | (23 559) | (3 723) | (46 244) | (12 708) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (100 347) | (98 678) | (17 614) | (11 513) | (5 067) | (7 400) | (20 393) | (35 436) |
| 5 | (5 052) | (132) | 707 | (69) | 12 | 1 196 | (45) |
| (102 434) | (106 000) | (25 125) | (12 029) | (28 695) | (11 111) | (65 441) | (48 189) |
| 926 228 | (3 175 311) | 161 537 | (376 239) | 75 672 | (81 749) | 125 868 | (757 135) |
| (496) | (425) | (77) | (38) | (29) | 0 | (31) | 7 |
| 18 | (18) | 0 | 0 | 0 | 0 | 2 | (2) |
| 925 750 | (3 175 754) | 161 460 | (376 277) | 75 643 | (81 749) | 125 839 | (757 130) |
| \$ 925 750 | \$ (3 175 754) | \$ 161 460 | \$ (376 277) | \$ 75 643 | \$ (81 749) | \$ 125 839 | \$ (757 130) |

Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds Income Fund | | Fonds Income Fund II | |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 3 152 681 | \$ 2 324 046 | \$ 4 946 | \$ 1 453 |
| Autres produits | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (1 632 305) | (2 773 433) | (426) | (1 292) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | 1 805 571 | 1 069 480 | (258) | 591 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | (175 035) | (158 142) | 277 | 29 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 3 151 147 | (7 858 396) | 3 842 | (3 257) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | (308 003) | 491 740 | 152 | 307 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | 29 185 | (36 840) | 18 | (18) |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 6 023 241 | (6 941 545) | 8 551 | (2 187) |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (597 826) | (558 064) | (1 198) | (362) |
| Frais de services | (13 417) | (14 853) | 0 | 0 |
| Frais de commercialisation | (33 017) | (29 379) | 0 | 0 |
| Autres charges | (3 814) | (3 771) | (4) | (2) |
| Total des charges | (648 074) | (606 067) | (1 202) | (364) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 1 008 | 1 010 | 0 | 0 |
| Charges d'exploitation nettes | (647 066) | (605 057) | (1 202) | (364) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 5 376 175 | (7 546 602) | 7 349 | (2 551) |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (21 455) | (5 028) | (74) | (2) |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | (2 035 924) | (1 522 465) | (3 972) | (828) |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | (21 307) | (7 362) | 114 | (88) |
| Total des frais financiers | (2 078 686) | (1 534 855) | (3 932) | (918) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 3 297 489 | (9 081 457) | 3 417 | (3 469) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (12 577) | (5 121) | (30) | (6) |
| Impôt sur les plus-values | 1 130 | (1 130) | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 3 286 042 | (9 087 708) | 3 387 | (3 475) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ 3 286 042 | \$ (9 087 708) | \$ 3 387 | \$ (3 475) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | | Fonds Low Average Duration Fund | | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | Fonds Low Duration Income Fund | |
|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 9 392 | \$ 18 013 | \$ 47 293 | \$ 25 484 | \$ 34 589 | \$ 14 422 | \$ 73 744 | \$ 39 539 |
| 2 | 0 | 447 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (8 994) | (11 601) | (22 219) | (42 813) | (11 239) | (20 974) | (32 020) | (56 562) |
| 11 493 | (14 589) | (5 675) | 10 878 | 6 089 | (52 392) | 21 011 | (38 394) |
| (654) | (1 046) | (133) | (1 316) | (737) | (1 354) | 2 090 | (394) |
| 18 657 | (43 168) | 39 445 | (57 779) | 44 578 | (35 028) | 81 076 | (91 374) |
| (8 175) | 3 742 | 1 240 | (1 564) | 1 050 | (1 725) | 11 644 | 4 463 |
| (5) | 46 | (223) | 253 | (152) | 115 | (488) | (601) |
| 21 716 | (48 603) | 60 175 | (66 857) | 74 178 | (96 936) | 157 057 | (143 323) |
| (4 033) | (4 863) | (5 214) | (7 440) | (4 399) | (3 531) | (9 191) | (7 436) |
| 0 | 0 | (57) | (84) | 0 | 0 | 0 | (1) |
| (36) | (41) | (47) | (59) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (3) | (3) | (1) | (1) | (11) | (2) |
| (4 069) | (4 904) | (5 321) | (7 586) | (4 400) | (3 532) | (9 202) | (7 439) |
| 0 | 0 | 168 | 169 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (4 069) | (4 904) | (5 153) | (7 417) | (4 400) | (3 532) | (9 202) | (7 439) |
| 17 647 | (53 507) | 55 022 | (74 274) | 69 778 | (100 468) | 147 855 | (150 762) |
| (344) | (42) | (9 866) | (1 538) | (1 541) | (323) | (741) | (200) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (571) | (732) | (1 606) | (985) | (538) | (399) | (8 680) | (4 686) |
| 17 | 50 | (110) | 51 | 0 | 3 | 2 000 | (564) |
| (898) | (724) | (11 582) | (2 472) | (2 079) | (719) | (7 421) | (5 450) |
| 16 749 | (54 231) | 43 440 | (76 746) | 67 699 | (101 187) | 140 434 | (156 212) |
| (300) | (369) | (17) | (33) | (10) | 0 | (8) | (5) |
| 0 | 0 | (179) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 16 449 | (54 600) | 43 244 | (76 779) | 67 689 | (101 187) | 140 426 | (156 217) |
| \$ 16 449 | \$ (54 600) | \$ 43 244 | \$ (76 779) | \$ 67 689 | \$ (101 187) | \$ 140 426 | \$ (156 217) |

Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds Low Duration Opportunities Fund | | Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | |
|---|---------------------------------------|-----------------------------------|---|--|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Période du 27 juillet 2022 au 31 décembre 2022 |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 43 539 | \$ 55 391 | \$ 228 | \$ 62 |
| Autres produits | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (39 342) | (193 300) | (30) | 2 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | (10 481) | (377 025) | (20) | (37) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | 10 187 | (6 253) | (5) | 9 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 71 442 | (143 747) | 133 | (22) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | 39 829 | (76 554) | 15 | (45) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | 167 | 132 | 0 | 1 |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 115 341 | (741 356) | 321 | (30) |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (5 106) | (13 186) | (26) | (11) |
| Frais de services | (15) | (20) | 0 | 0 |
| Frais de commercialisation | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Autres charges | (26) | (7) | 0 | 0 |
| Total des charges | (5 147) | (13 213) | (26) | (11) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 209 | 214 | 0 | 0 |
| Charges d'exploitation nettes | (4 938) | (12 999) | (26) | (11) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 110 403 | (754 355) | 295 | (41) |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (752) | (379) | 0 | 0 |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | (5 757) | (7 886) | (1) | 0 |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | (541) | 104 | 0 | 0 |
| Total des frais financiers | (7 050) | (8 161) | (1) | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 103 353 | (762 516) | 294 | (41) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | 93 | (87) | (2) | 0 |
| Impôt sur les plus-values | (159) | (7) | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 103 287 | (762 610) | 292 | (41) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ 103 287 | \$ (762 610) | \$ 292 | \$ (41) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | | Fonds Mortgage Opportunities Fund | | Fonds StocksPLUS™ Fund | | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 4 688 | \$ 4 517 | \$ 48 765 | \$ 64 142 | \$ 78 334 | \$ 33 258 | \$ 468 | \$ 200 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 34 | 0 | 0 | 0 |
| 3 004 | 12 875 | (53 254) | (104 200) | (27 114) | (81 088) | (192) | (38) |
| 10 690 | 9 251 | 30 901 | (29 390) | 254 209 | (489 873) | 2 220 | (2 250) |
| 17 | (73) | (2 540) | (5 448) | (3 796) | (4 542) | (26) | 18 |
| (1 568) | (1 853) | 79 879 | (167 826) | 48 513 | (73 113) | 233 | (374) |
| (1 244) | 815 | (27 098) | (16 819) | 26 357 | (87 127) | 9 | (231) |
| 3 | 3 | 1 428 | (1 441) | 68 | (18) | 0 | 0 |
| 15 590 | 25 535 | 78 081 | (260 982) | 376 605 | (702 503) | 2 712 | (2 675) |
| (1 104) | (1 351) | (5 672) | (9 762) | (11 635) | (12 870) | (76) | (73) |
| 0 | 0 | (88) | (116) | (85) | (60) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (9) | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (8) | (17) | (27) | (6) | 0 | 0 |
| (1 104) | (1 351) | (5 777) | (9 896) | (11 747) | (12 936) | (76) | (73) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 1 |
| (1 104) | (1 351) | (5 777) | (9 896) | (11 747) | (12 936) | (75) | (72) |
| 14 486 | 24 184 | 72 304 | (270 878) | 364 858 | (715 439) | 2 637 | (2 747) |
| (39) | (21) | (13 330) | (7 142) | (953) | (199) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1 287) | (1 973) | (3 105) | (9 330) | (1 045) | (218) | 0 | 0 |
| (48) | (158) | (1 042) | (159) | 29 | (322) | 0 | 0 |
| (1 374) | (2 152) | (17 477) | (16 631) | (1 969) | (739) | 0 | 0 |
| 13 112 | 22 032 | 54 827 | (287 509) | 362 889 | (716 178) | 2 637 | (2 747) |
| (580) | (1 066) | 0 | 0 | (20) | 10 | (1) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 12 532 | 20 966 | 54 827 | (287 509) | 362 869 | (716 168) | 2 636 | (2 747) |
| \$ 12 532 | \$ 20 966 | \$ 54 827 | \$ (287 509) | \$ 362 869 | \$ (716 168) | \$ 2 636 | \$ (2 747) |

Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds Strategic Income Fund | | Fonds Total Return Bond Fund | |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Produits | | | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 23 182 | \$ 24 332 | \$ 179 835 | \$ 114 210 |
| Autres produits | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (7 187) | (10 791) | (122 939) | (308 687) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | 19 261 | (40 272) | (6 006) | 18 095 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | (452) | (504) | (2 380) | (10 559) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 29 411 | (66 591) | 276 545 | (628 624) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | (11 204) | 16 280 | (26 913) | 2 689 |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | 146 | (284) | 530 | (795) |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 53 157 | (77 830) | 298 672 | (813 671) |
| Charges d'exploitation | | | | |
| Frais de gestion | (6 178) | (7 425) | (31 945) | (32 300) |
| Frais de services | 0 | 0 | (1 648) | (1 509) |
| Frais de commercialisation | 0 | 0 | (900) | (722) |
| Autres charges | (100) | (105) | (40) | (44) |
| Total des charges | (6 278) | (7 530) | (34 533) | (34 575) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 0 | 0 | 0 | 512 |
| Charges d'exploitation nettes | (6 278) | (7 530) | (34 533) | (34 063) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 46 879 | (85 360) | 264 139 | (847 734) |
| Frais financiers | | | | |
| Frais des intérêts | (633) | (225) | (1 591) | (857) |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | (5 258) | (5 529) | (20 419) | (14 771) |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | (501) | 171 | (82) | 138 |
| Total des frais financiers | (6 392) | (5 583) | (22 092) | (15 490) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 40 487 | (90 943) | 242 047 | (863 224) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (1 288) | (1 177) | (161) | (288) |
| Impôt sur les plus-values | (121) | (9) | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 39 078 | (92 129) | 241 886 | (863 512) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ 39 078 | \$ (92 129) | \$ 241 886 | \$ (863 512) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | Fonds UK Corporate Bond Fund | | Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | Fonds US High Yield Bond Fund | |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 16 252 | \$ 3 645 | £ 15 303 | £ 11 760 | £ 14 244 | £ 11 151 | \$ 120 057 | \$ 156 507 |
| 0 | 0 | 30 | 0 | 83 | 0 | 365 | 0 |
| 775 | (4 374) | (27 836) | (30 472) | (17 071) | (27 835) | (155 169) | (135 436) |
| (24 632) | 1 422 | 6 605 | (18 338) | 1 241 | (26 173) | 19 377 | (77 001) |
| (3 823) | (599) | (822) | (25) | (481) | 131 | 283 | (1 909) |
| (2 673) | 4 540 | 41 320 | (66 723) | 30 886 | (80 017) | 271 410 | (441 841) |
| (613) | (7 427) | (2 851) | 3 502 | 1 542 | 1 687 | (5 206) | 3 016 |
| 76 | (70) | 385 | 96 | 603 | 79 | (35) | 51 |
| (14 638) | (2 863) | 32 134 | (100 200) | 31 047 | (120 977) | 251 082 | (496 613) |
| (4 329) | (2 340) | (1 309) | (1 843) | (1 421) | (1 596) | (13 288) | (18 237) |
| (13) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (924) | (1 231) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (3) | (1) | (8) | (2) | (39) | (10) |
| (4 342) | (2 340) | (1 312) | (1 844) | (1 429) | (1 598) | (14 251) | (19 478) |
| 81 | 25 | 16 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (4 261) | (2 315) | (1 296) | (1 832) | (1 429) | (1 598) | (14 251) | (19 478) |
| (18 899) | (5 178) | 30 838 | (102 032) | 29 618 | (122 575) | 236 831 | (516 091) |
| (374) | (89) | (939) | (164) | (243) | (76) | (413) | (38) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (470) | (553) |
| (2 439) | (319) | (7 360) | (7 385) | (1 587) | (1 401) | (20 197) | (28 068) |
| (85) | 159 | (113) | 147 | (40) | 0 | 198 | (1 127) |
| (2 898) | (249) | (8 412) | (7 402) | (1 870) | (1 477) | (20 882) | (29 786) |
| (21 797) | (5 427) | 22 426 | (109 434) | 27 748 | (124 052) | 215 949 | (545 877) |
| 0 | 0 | 0 | 6 | 0 | 0 | 0 | (22) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (21 797) | (5 427) | 22 426 | (109 428) | 27 748 | (124 052) | 215 949 | (545 899) |
| \$ (21 797) | \$ (5 427) | £ 22 426 | £ (109 428) | £ 27 748 | £ (124 052) | \$ 215 949 | \$ (545 899) |

Compte de résultat (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | |
|---|--|--------------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Produits | | |
| Produits des intérêts et dividendes | \$ 19 606 | \$ 18 748 |
| Autres produits | 0 | 0 |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | (7 531) | (82 238) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés | (533) | (42 587) |
| Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change | 258 | (237) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit | 25 385 | (56 269) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés | 5 246 | (8 065) |
| Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change | (153) | 93 |
| Total des revenus/(pertes) sur investissements | 42 278 | (170 555) |
| Charges d'exploitation | | |
| Frais de gestion | (2 511) | (2 797) |
| Frais de services | 0 | 0 |
| Frais de commercialisation | 0 | 0 |
| Autres charges | (1) | (1) |
| Total des charges | (2 512) | (2 798) |
| Remboursement effectué par les Conseillers en investissement | 0 | 0 |
| Charges d'exploitation nettes | (2 512) | (2 798) |
| Bénéfice/(perte) net(te) sur investissements | 39 766 | (173 353) |
| Frais financiers | | |
| Frais des intérêts | (59) | (42) |
| Frais de facilité de crédit | 0 | 0 |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables | (4 167) | (6 002) |
| Crédits et (charges) net(te)s de péréquation | 100 | (1 021) |
| Total des frais financiers | (4 126) | (7 065) |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt | 35 640 | (180 418) |
| Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement | (64) | (60) |
| Impôt sur les plus-values | 0 | 0 |
| Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt | 35 576 | (180 478) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | \$ 35 576 | \$ (180 478) |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Tous les montants proviennent uniquement des activités en vertu du principe de continuité d'exploitation.

* Le Total Société de l'exercice clos le 31 décembre 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022 a été ajusté pour éliminer les investissements croisés. Veuillez vous reporter à la Note 14 dans les Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

| Fonds US Short-Term Fund | | Total Société* | |
|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 99 844 | \$ 55 566 | \$ 7 470 870 | \$ 6 178 757 |
| 0 | 0 | 19 696 | 0 |
| (31 452) | (71 854) | (6 487 698) | (8 968 907) |
| 8 463 | 58 715 | 2 712 849 | (2 110 326) |
| (1 056) | (2 268) | (336 990) | (570 612) |
| 64 461 | (75 579) | 10 751 115 | (21 700 661) |
| (12 479) | 16 121 | 597 760 | (473 258) |
| 15 | (37) | 52 339 | (34 364) |
| 127 796 | (19 336) | 14 779 941 | (27 679 371) |
| (8 363) | (10 218) | (1 330 072) | (1 395 118) |
| (39) | (51) | (22 947) | (25 946) |
| 0 | 0 | (39 781) | (36 489) |
| (3) | (3) | (6 703) | (6 292) |
| (8 405) | (10 272) | (1 399 503) | (1 463 845) |
| 718 | 874 | 10 067 | 12 309 |
| (7 687) | (9 398) | (1 389 436) | (1 451 536) |
| 120 109 | (28 734) | 13 390 505 | (29 130 907) |
| (449) | (1 332) | (218 100) | (69 903) |
| 0 | 0 | (1 325) | (1 257) |
| (34 453) | (15 307) | (2 754 277) | (2 279 520) |
| (69) | 896 | (28 535) | (23 010) |
| (34 971) | (15 743) | (3 002 237) | (2 373 690) |
| 85 138 | (44 477) | 10 388 268 | (31 504 597) |
| (2) | 1 | (24 685) | (21 859) |
| 0 | 0 | (1 021) | (1 417) |
| 85 136 | (44 476) | 10 362 562 | (31 527 873) |
| \$ 85 136 | \$ (44 476) | \$ 10 362 562 | \$ (31 527 873) |

État de l'évolution des actifs nets

| (Montants en milliers) | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund ⁽¹⁾ | |
|--|---------------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|--|-----------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Actifs nets au début de l'exercice | \$ 2 981 392 | \$ 3 411 923 | \$ 313 987 | \$ 361 011 | \$ 750 076 | \$ 1 035 021 |
| Produits des actions émises | 628 884 | 2 053 140 | 95 633 | 98 659 | 110 446 | 175 286 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 3 210 | 10 176 | 1 079 | 762 | 10 | 7 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (1 154 141) | (1 858 479) | (229 012) | (89 514) | (264 375) | (235 350) |
| Ajustement du taux de change notionnel | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | (24 617) | (635 368) | (4 479) | (56 931) | 73 959 | (224 888) |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | \$ 2 434 728 | \$ 2 981 392 | \$ 177 208 | \$ 313 987 | \$ 670 116 | \$ 750 076 |

| | Fonds Diversified Income Fund | | Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | | Fonds Diversified Income ESG Fund | |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|--|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Période du 27 juillet 2022 au 31 décembre 2022 |
| Actifs nets au début de l'exercice | \$ 8 751 796 | \$ 16 447 733 | \$ 564 684 | \$ 1 305 365 | \$ 9 854 | \$ 0 |
| Produits des actions émises | 1 312 783 | 1 896 447 | 28 282 | 68 633 | 50 850 | 9 954 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 14 853 | 16 545 | 51 | 34 | 0 | 0 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (3 265 481) | (6 169 181) | (229 271) | (612 551) | (6 217) | 0 |
| Ajustement du taux de change notionnel | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 625 847 | (3 439 748) | 49 093 | (196 797) | 3 076 | (100) |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | \$ 7 439 798 | \$ 8 751 796 | \$ 412 839 | \$ 564 684 | \$ 57 563 | \$ 9 854 |

| | Fonds Emerging Markets Bond Fund | | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | | Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------|-----------------------------------|--|-----------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Actifs nets au début de l'exercice | \$ 3 305 979 | \$ 4 714 744 | \$ 2 492 475 | \$ 2 635 769 | \$ 168 986 | \$ 212 894 |
| Produits des actions émises | 1 315 271 | 1 975 229 | 824 351 | 1 511 574 | 6 131 | 26 594 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 2 893 | 3 115 | 1 110 | 2 170 | 0 | 0 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (1 140 746) | (2 402 706) | (875 929) | (948 773) | (29 388) | (30 165) |
| Ajustement du taux de change notionnel | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 362 888 | (984 403) | 251 914 | (708 265) | 11 984 | (40 337) |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | \$ 3 846 285 | \$ 3 305 979 | \$ 2 693 921 | \$ 2 492 475 | \$ 157 713 | \$ 168 986 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

⁽¹⁾ Le Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund a été renommé Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund le 29 novembre 2023.

| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | Fonds PIMCO Climate Bond Fund | | Fonds Commodity Real Return Fund | | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | |
|---|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|--|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 5 721 591 | \$ 9 110 409 | \$ 292 655 | \$ 328 081 | \$ 1 369 877 | \$ 1 444 182 | \$ 97 153 | \$ 139 704 |
| 1 523 897 | 1 684 526 | 115 085 | 140 136 | 357 526 | 1 475 400 | 7 287 | 9 058 |
| 9 386 | 10 326 | 6 | 136 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2 473 767) | (3 728 874) | (167 821) | (101 860) | (768 414) | (1 623 269) | (13 621) | (38 655) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 356 779 | (1 354 796) | 22 391 | (73 838) | (100 087) | 73 564 | 9 244 | (12 954) |
| \$ 5 137 886 | \$ 5 721 591 | \$ 262 316 | \$ 292 655 | \$ 858 902 | \$ 1 369 877 | \$ 100 063 | \$ 97 153 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | | Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | | Fonds Emerging Local Bond Fund | | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | |
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Période du 27 juillet 2022 au 31 décembre 2022 |
| \$ 3 483 601 | \$ 3 277 997 | € 5 115 170 | € 7 635 950 | \$ 1 919 668 | \$ 2 151 129 | \$ 6 609 | \$ 0 |
| 501 746 | 1 763 140 | 381 815 | 862 412 | 1 657 250 | 803 400 | 91 524 | 6 206 |
| 1 248 | 1 413 | 55 | 92 | 1 946 | 1 998 | 4 | 1 |
| (893 774) | (1 068 332) | (2 168 667) | (2 381 432) | (1 047 135) | (864 659) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 352 752 | (490 617) | (66 328) | (1 001 852) | 349 212 | (172 200) | 4 271 | 402 |
| \$ 3 445 573 | \$ 3 483 601 | € 3 262 045 | € 5 115 170 | \$ 2 880 941 | \$ 1 919 668 | \$ 102 408 | \$ 6 609 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | Fonds PIMCO ESG Income Fund | | Fonds Euro Bond Fund | |
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 205 131 | \$ 290 475 | \$ 20 937 | \$ 29 760 | \$ 237 961 | \$ 125 087 | € 1 913 275 | € 2 574 129 |
| 81 173 | 167 062 | 3 869 | 8 145 | 213 650 | 172 394 | 381 446 | 335 598 |
| 51 | 20 | 0 | 0 | 930 | 465 | 1 | 0 |
| (29 759) | (212 974) | (6 716) | (15 231) | (196 750) | (38 588) | (763 849) | (595 105) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 26 194 | (39 452) | 1 856 | (1 737) | 15 417 | (21 397) | 140 840 | (401 347) |
| \$ 282 790 | \$ 205 131 | \$ 19 946 | \$ 20 937 | \$ 271 208 | \$ 237 961 | € 1 671 713 | € 1 913 275 |

État de l'évolution des actifs nets (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds Euro Credit Fund | | Fonds Euro Income Bond Fund | | Fonds Euro Long Average Duration Fund | |
|---|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--|--------------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Actifs nets au début de l'exercice | € 610 008 | € 1 017 163 | € 1 352 980 | € 2 482 304 | € 110 048 | € 160 601 |
| Produits des actions émises | 131 415 | 434 310 | 323 596 | 446 648 | 819 102 | 40 010 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 0 | 320 | 23 | 1 221 | 0 | 0 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (253 794) | (673 784) | (376 474) | (1 293 838) | (51 624) | (31 391) |
| Ajustement du taux de change notionnel | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 49 557 | (168 001) | 87 102 | (283 355) | 46 443 | (59 172) |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | € 537 186 | € 610 008 | € 1 387 227 | € 1 352 980 | € 923 969 | € 110 048 |
| | Fonds Global Bond Fund | | Fonds Global Bond ESG Fund | | Fonds Global Bond Ex-US Fund | |
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Actifs nets au début de l'exercice | \$ 11 420 112 | \$ 14 038 846 | \$ 3 106 190 | \$ 2 302 966 | \$ 716 022 | \$ 911 707 |
| Produits des actions émises | 5 083 690 | 3 949 985 | 1 603 900 | 1 882 825 | 264 163 | 307 762 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 3 136 | 3 168 | 7 529 | 4 271 | 940 | 678 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (4 397 276) | (4 441 247) | (1 423 710) | (657 548) | (248 064) | (406 302) |
| Ajustement du taux de change notionnel | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 967 600 | (2 130 640) | 267 271 | (426 324) | 67 065 | (97 823) |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | \$ 13 077 262 | \$ 11 420 112 | \$ 3 561 180 | \$ 3 106 190 | \$ 800 126 | \$ 716 022 |
| | Fonds Global Real Return Fund | | Fonds Income Fund | | Fonds Income Fund II | |
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| Actifs nets au début de l'exercice | \$ 2 571 862 | \$ 3 703 379 | \$ 57 980 327 | \$ 73 579 726 | \$ 56 623 | \$ 27 770 |
| Produits des actions émises | 476 053 | 881 779 | 25 296 693 | 18 117 060 | 135 551 | 35 679 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 2 264 | 4 676 | 159 846 | 124 031 | 36 | 62 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (794 925) | (1 260 842) | (16 179 791) | (24 752 782) | (70 437) | (3 413) |
| Ajustement du taux de change notionnel | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 125 839 | (757 130) | 3 286 042 | (9 087 708) | 3 387 | (3 475) |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | \$ 2 381 093 | \$ 2 571 862 | \$ 70 543 117 | \$ 57 980 327 | \$ 125 160 | \$ 56 623 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| Fonds Euro Short-Term Fund | | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | | Fonds Global Advantage Fund | |
|-----------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|--|-----------------------------------|--|-----------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| € 353 095 | € 629 859 | € 174 162 | € 170 489 | € 211 172 | € 395 491 | \$ 410 459 | \$ 521 067 |
| 88 943 | 249 387 | 239 216 | 37 975 | 37 094 | 69 639 | 9 823 | 25 733 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (257 754) | (518 005) | (80 655) | (18 172) | (123 728) | (243 049) | (19 644) | (53 865) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 9 230 | (8 146) | 35 044 | (16 130) | 6 072 | (10 909) | 31 652 | (82 476) |
| € 193 514 | € 353 095 | € 367 767 | € 174 162 | € 130 610 | € 211 172 | \$ 432 290 | \$ 410 459 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | | Fonds Global Investment Grade Credit Fund | | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | Fonds Global Low Duration Real Return Fund | |
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 3 102 868 | \$ 5 169 160 | \$ 10 538 341 | \$ 17 154 925 | \$ 1 369 890 | \$ 1 189 563 | \$ 1 364 375 | \$ 1 199 076 |
| 959 875 | 1 424 841 | 4 964 595 | 3 907 121 | 1 183 344 | 1 086 602 | 320 911 | 1 093 289 |
| 2 851 | 2 721 | 3 812 | 4 308 | 25 | 366 | 17 | 2 |
| (1 427 666) | (2 631 133) | (5 718 776) | (7 352 259) | (544 512) | (530 364) | (583 894) | (846 243) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 342 322 | (862 721) | 925 750 | (3 175 754) | 161 460 | (376 277) | 75 643 | (81 749) |
| \$ 2 980 250 | \$ 3 102 868 | \$ 10 713 722 | \$ 10 538 341 | \$ 2 170 207 | \$ 1 369 890 | \$ 1 177 052 | \$ 1 364 375 |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | | Fonds Low Average Duration Fund | | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | Fonds Low Duration Income Fund | |
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 403 078 | \$ 164 345 | \$ 1 072 758 | \$ 1 179 138 | \$ 654 749 | \$ 806 869 | \$ 1 084 380 | \$ 1 367 475 |
| 18 429 | 474 503 | 244 183 | 1 413 022 | 385 826 | 182 884 | 1 115 457 | 597 584 |
| 141 | 230 | 582 | 309 | 367 | 254 | 120 | 67 |
| (184 849) | (181 400) | (550 922) | (1 442 932) | (135 788) | (234 071) | (310 078) | (724 529) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 16 449 | (54 600) | 43 244 | (76 779) | 67 689 | (101 187) | 140 426 | (156 217) |
| \$ 253 248 | \$ 403 078 | \$ 809 845 | \$ 1 072 758 | \$ 972 843 | \$ 654 749 | \$ 2 030 305 | \$ 1 084 380 |

État de l'évolution des actifs nets (suite)

| (Montants en milliers) | Fonds Low Duration Opportunities Fund | | Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | | Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | |
|--|---------------------------------------|-----------------------------------|---|--|--|-----------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Période du 27 juillet 2022 au 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| | | | | | | |
| Actifs nets au début de l'exercice | \$ 1 345 781 | \$ 3 217 260 | \$ 4 928 | \$ 0 | \$ 120 137 | \$ 100 538 |
| Produits des actions émises | 324 163 | 880 588 | 0 | 4 969 | 12 242 | 78 857 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 2 288 | 869 | 1 | 0 | 5 | 6 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (987 895) | (1 990 326) | 0 | 0 | (46 423) | (80 230) |
| Ajustement du taux de change notionnel | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 103 287 | (762 610) | 292 | (41) | 12 532 | 20 966 |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | \$ 787 624 | \$ 1 345 781 | \$ 5 221 | \$ 4 928 | \$ 98 493 | \$ 120 137 |

| | Fonds Total Return Bond Fund | | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | Fonds UK Corporate Bond Fund | |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| | | | | | | |
| Actifs nets au début de l'exercice | \$ 4 150 717 | \$ 4 944 898 | \$ 435 924 | \$ 101 789 | £ 389 173 | £ 592 164 |
| Produits des actions émises | 1 093 709 | 1 455 704 | 127 972 | 446 424 | 76 354 | 89 056 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 10 647 | 8 134 | 8 | 2 | 0 | 1 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (1 076 908) | (1 394 507) | (301 761) | (106 864) | (126 892) | (182 620) |
| Ajustement du taux de change notionnel | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 241 886 | (863 512) | (21 797) | (5 427) | 22 426 | (109 428) |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | \$ 4 420 051 | \$ 4 150 717 | \$ 240 346 | \$ 435 924 | £ 361 061 | £ 389 173 |

| | Total Société* | |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|
| | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| | | |
| Actifs nets au début de l'exercice | \$ 151 524 519 | \$ 209 342 798 |
| Produits des actions émises | 58 350 142 | 59 195 422 |
| Produits des réinvestissements des distributions | 265 656 | 229 935 |
| Paiements au titre du rachat d'actions | (55 777 199) | (84 448 259) |
| Ajustement du taux de change notionnel | 376 875 | (1 267 504) |
| Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation | 10 362 562 | (31 527 873) |
| Actifs nets à la fin de l'exercice | \$ 165 102 555 | \$ 151 524 519 |

Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

* Le Total Société de l'exercice clos le 31 décembre 2023 et de l'exercice clos le 31 décembre 2022 a été ajusté pour éliminer les investissements croisés. Veuillez vous reporter à la Note 14 dans les Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

| Fonds Mortgage Opportunities Fund | | Fonds StocksPLUS™ Fund | | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | | Fonds Strategic Income Fund | |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| \$ 849 148 | \$ 2 238 424 | \$ 1 008 739 | \$ 3 761 156 | \$ 9 528 | \$ 11 610 | \$ 506 557 | \$ 619 928 |
| 461 414 | 944 728 | 1 446 815 | 951 977 | 1 944 | 1 511 | 35 988 | 179 697 |
| 482 | 4 620 | 1 034 | 215 | 0 | 0 | 22 | 15 |
| (440 615) | (2 051 115) | (856 469) | (2 988 441) | (2 933) | (846) | (131 696) | (200 954) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 54 827 | (287 509) | 362 869 | (716 168) | 2 636 | (2 747) | 39 078 | (92 129) |
| \$ 925 256 | \$ 849 148 | \$ 1 962 988 | \$ 1 008 739 | \$ 11 175 | \$ 9 528 | \$ 449 949 | \$ 506 557 |

| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | Fonds US High Yield Bond Fund | | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | | Fonds US Short-Term Fund | |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
| £ 325 020 | £ 425 748 | \$ 1 984 922 | \$ 3 923 786 | \$ 388 522 | \$ 878 100 | \$ 2 310 115 | \$ 2 650 198 |
| 7 700 | 108 291 | 442 006 | 744 251 | 260 302 | 223 870 | 557 195 | 1 278 210 |
| 2 | 2 | 3 440 | 5 395 | 66 | 3 292 | 29 132 | 13 355 |
| (35 702) | (84 969) | (773 430) | (2 142 611) | (203 605) | (536 262) | (1 127 372) | (1 587 172) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 27 748 | (124 052) | 215 949 | (545 899) | 35 576 | (180 478) | 85 136 | (44 476) |
| £ 324 768 | £ 325 020 | \$ 1 872 887 | \$ 1 984 922 | \$ 480 861 | \$ 388 522 | \$ 1 854 206 | \$ 2 310 115 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------|
| INDE | | | | INDONÉSIE | | | | SINGAPOUR | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| Adani Green Energy Ltd. 4,375 % éch. 08/09/2024 | \$ 4 800 | \$ 4 638 | 0,19 | Adaro Indonesia PT 4,250 % éch. 31/10/2024 | 23 174 | 22 603 | 0,93 | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % éch. 25/03/2027 | \$ 6 705 | \$ 6 133 | 0,25 | |
| Adani Green Energy UP Ltd. 6,250 % éch. 10/12/2024 | 12 041 | 11 913 | 0,49 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,750 % éch. 30/03/2026 (f) | 12 354 | 11 810 | 0,48 | GLP Pte. Ltd. 3,875 % éch. 04/06/2025 | 11 475 | 7 631 | 0,31 | |
| GMR Hyderabad International Airport Ltd. 4,250 % éch. 27/10/2027 | 4 878 | 4 476 | 0,18 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 4,300 % éch. 24/03/2027 (d)(f) | 15 300 | 13 595 | 0,56 | 4,500 % éch. 17/05/2026 (d) | 7 400 | 2 372 | 0,10 | |
| HDFC Bank Ltd. 3,700 % éch. 25/08/2026 (d)(f) | 11 068 | 10 100 | 0,42 | Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7,750 % éch. 10/02/2026 | 14 656 | 13 972 | 0,57 | 4,600 % éch. 29/06/2027 (d) | 7 000 | 2 205 | 0,09 | |
| JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % éch. 18/05/2031 | 17 428 | 15 204 | 0,62 | Cikarang Listrindo Tbk PT 4,950 % éch. 14/09/2026 | 443 | 426 | 0,02 | Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % éch. 22/10/2025 | 6 000 | 6 029 | 0,25 | |
| JSW Steel Ltd. 5,050 % éch. 05/04/2032 | 4 600 | 3 967 | 0,16 | LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % éch. 04/02/2039 | 7 483 | 7 222 | 0,30 | Medco Bell Pte. Ltd. 6,375 % éch. 30/01/2027 | 16 567 | 15 785 | 0,65 | |
| Network i2i Ltd. 3,975 % éch. 03/03/2026 (d) | 8 300 | 7 740 | 0,32 | Minejesa Capital BV 4,625 % éch. 10/08/2030 | 4 700 | 4 471 | 0,18 | Medco Maple Tree Pte Ltd. 8,960 % éch. 27/04/2029 | 10 600 | 10 781 | 0,44 | |
| 5,650 % éch. 15/01/2025 (d) | 7 700 | 7 626 | 0,31 | Pakuwon Jati Tbk PT 4,875 % éch. 29/04/2028 | 8 300 | 7 736 | 0,32 | Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % éch. 14/05/2026 | 13 671 | 13 591 | 0,56 | |
| Periama Holdings LLC 5,950 % éch. 19/04/2026 | 51 000 | 50 326 | 2,07 | Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,875 % éch. 01/10/2024 | 7 200 | 7 151 | 0,29 | TML Holdings Pte. Ltd. 4,350 % éch. 09/06/2026 | 4 000 | 3 800 | 0,16 | |
| ReNew Wind Energy AP2 4,500 % éch. 14/07/2028 | 30 988 | 27 567 | 1,13 | Saka Energi Indonesia PT 4,450 % éch. 05/05/2024 | 2 621 | 2 601 | 0,11 | 5,500 % éch. 03/06/2024 | 13 524 | 13 439 | 0,55 | |
| Shriram Finance Ltd. 4,400 % éch. 13/03/2024 | 31 358 | 31 167 | 1,28 | Total Indonésie | 91 587 | 3,76 | Total Inde | 198 982 | 8,17 | Total Singapour | 81 766 | 3,36 |
| Total Inde | 198 982 | 8,17 | | | | | | | | | | |
| MEXIQUE | | | | ITALIE | | | | AFRIQUE DU SUD | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| Banco Mercantil del Norte S.A. 5,875 % éch. 24/01/2027 (d)(f) | 6 150 | 5 666 | 0,23 | Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029 | € 6 900 | 6 748 | 0,28 | Sasol Financing USA LLC 6,500 % éch. 27/09/2028 | 6 700 | 6 390 | 0,26 | |
| 6,750 % éch. 27/09/2024 (d)(f) | 1 700 | 1 682 | 0,07 | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | | | | | |
| Total Mexique | 7 348 | 0,30 | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| | | | | ACEN Finance Ltd. 4,000 % éch. 08/03/2025 (d) | 7 200 | 4 633 | 0,19 | | | | | |
| MONGOLIE | | | | REPUBLIQUE DU MALI | | | | CORÉE DU SUD | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement mongol 4,450 % éch. 07/07/2031 | 13 000 | 10 925 | 0,45 | Seaspan Corp. 5,500 % éch. 01/08/2029 | 8 500 | 7 118 | 0,29 | SK Hynix, Inc. 2,375 % éch. 19/01/2031 | 2 300 | 1 867 | 0,08 | |
| 5,125 % éch. 07/04/2026 | 18 095 | 17 595 | 0,72 | ÎLE MAURICE | | | | 6,375 % éch. 17/01/2028 | 4 900 | 5 060 | 0,21 | |
| 7,875 % éch. 05/06/2029 | 200 | 205 | 0,01 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| 8,650 % éch. 19/01/2028 | 16 002 | 16 791 | 0,69 | ACEN Finance Ltd. 4,000 % éch. 08/03/2025 (d) | 7 200 | 4 633 | 0,19 | Tongyang Life Insurance Co. Ltd. 5,250 % éch. 22/09/2025 (d) | 7 300 | 6 716 | 0,27 | |
| Total Mongolie | 45 516 | 1,87 | | Globe Telecom, Inc. 3,000 % éch. 23/07/2035 | 8 150 | 6 125 | 0,25 | Total Corée du Sud | 13 643 | 0,56 | | |
| | | | | 4,200 % éch. 02/08/2026 (d) | 17 700 | 16 758 | 0,69 | | | | | |
| PAYS-BAS | | | | OMAN | | | | SRI LANKA | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | |
| Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % éch. 07/05/2029 | 26 063 | 24 271 | 1,00 | Obligation internationale du gouvernement omanais 7,000 % éch. 25/01/2051 | 4 600 | 4 977 | 0,20 | Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka 5,750 % éch. 18/04/2023 ^ | 19 512 | 10 036 | 0,41 | |
| Prosus NV 4,193 % éch. 19/01/2032 | 8 500 | 7 339 | 0,30 | | | | | 6,200 % éch. 11/05/2027 ^ | 23 800 | 12 086 | 0,50 | |
| 4,987 % éch. 19/01/2052 | 6 000 | 4 516 | 0,18 | | | | | 6,350 % éch. 28/06/2024 ^ | 10 500 | 5 348 | 0,22 | |
| Total Pays-Bas | 36 126 | 1,48 | | | | | | 6,750 % éch. 18/04/2028 ^ | 9 000 | 4 550 | 0,19 | |
| | | | | | | | | 6,825 % éch. 18/07/2026 ^ | 4 500 | 2 315 | 0,09 | |
| OMAN | | | | PAKISTAN | | | | THAÏLANDE | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement omanais 7,000 % éch. 25/01/2051 | 4 600 | 4 977 | 0,20 | Obligation internationale du gouvernement pakistanais 6,000 % éch. 08/04/2026 | 56 171 | 39 822 | 1,64 | Bangkok Bank PCL 5,000 % éch. 23/09/2025 (d)(f) | 23 300 | 22 329 | 0,92 | |
| | | | | 6,875 % éch. 05/12/2027 | 56 757 | 38 961 | 1,60 | Kasikornbank PCL 3,343 % éch. 02/10/2031 (f) | 3 200 | 2 945 | 0,12 | |
| | | | | 7,375 % éch. 08/04/2031 | 16 200 | 9 930 | 0,41 | 5,275 % éch. 14/10/2025 (d)(f) | 30 357 | 29 101 | 1,19 | |
| | | | | 8,250 % éch. 15/04/2024 | 2 400 | 2 282 | 0,09 | Muang Thai Life Assurance PCL 3,552 % éch. 27/01/2037 (f) | 5 826 | 5 365 | 0,22 | |
| | | | | 8,250 % éch. 30/09/2025 | 9 235 | 7 871 | 0,32 | Total Thaïlande | 59 740 | 2,45 | | |
| Total OMAN | 98 866 | 4,06 | | Total Pakistan | 98 866 | 4,06 | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | |
| PHILIPPINES | | | | ROYAUME-UNI | | | | TURQUIE | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| ACEN Finance Ltd. 4,000 % éch. 08/03/2025 (d) | 7 200 | 4 633 | 0,19 | Diamond Ltd. 7,950 % éch. 28/07/2026 | 2 400 | 2 402 | 0,10 | Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği A/S 8,250 % éch. 15/11/2028 | 6 100 | 6 377 | 0,26 | |
| Globe Telecom, Inc. 3,000 % éch. 23/07/2035 | 8 150 | 6 125 | 0,25 | | | | | | | | | |
| 4,200 % éch. 02/08/2026 (d) | 17 700 | 16 758 | 0,69 | | | | | | | | | |
| Petron Corp. 5,950 % éch. 19/04/2026 (d) | 6 260 | 5 861 | 0,24 | | | | | | | | | |
| Royal Capital BV 4,875 % éch. 05/05/2024 (d) | 10 571 | 10 501 | 0,43 | | | | | | | | | |
| 5,000 % éch. 05/02/2026 (d) | 900 | 882 | 0,04 | | | | | | | | | |
| San Miguel Corp. 5,500 % éch. 29/07/2025 (d) | 11 850 | 11 021 | 0,45 | | | | | | | | | |
| SMC Global Power Holdings Corp. 5,450 % éch. 09/12/2026 (d) | 7 875 | 6 306 | 0,26 | | | | | | | | | |
| 5,700 % éch. 21/01/2026 (d) | 3 754 | 3 089 | 0,13 | | | | | | | | | |
| 5,950 % éch. 05/05/2025 (d) | 9 000 | 7 942 | 0,32 | | | | | | | | | |
| 7,000 % éch. 21/10/2025 (d) | 16 884 | 15 055 | 0,62 | | | | | | | | | |
| Total Philippines | 88 173 | 3,62 | | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Standard Chartered PLC 4,750 % éch. 14/01/2031 (d)(f) | \$ 8 300 | \$ 6 774 | 0,28 | ÎLES VIERGES BRITANNIQUES | | | | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| 6,000 % éch. 26/07/2025 (d)(f)(h) | 30 000 | 29 507 | 1,21 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | BILLETS À COURT TERME | | | |
| 7,750 % éch. 15/08/2027 (d)(f)(h) | 58 600 | 59 988 | 2,46 | Celestial Miles Ltd. 5,750 % éch. 31/01/2024 (d) | \$ 24 504 | \$ 24 455 | 1,00 | Yango Justice International Ltd. 10,250 % éch. 15/09/2022 ^ | \$ 4 500 | \$ 25 | 0,00 |
| Vedanta Resources Finance PLC 8,950 % éch. 11/03/2025 | 39 192 | 29 180 | 1,20 | Champion Path Holdings Ltd. 4,500 % éch. 27/01/2026 | 17 700 | 16 525 | 0,68 | Total des Instruments à court terme | | 25 | 0,00 |
| Total Royaume-Uni | | 127 851 | 5,25 | 4,850 % éch. 27/01/2028 | 7 100 | 6 104 | 0,25 | Total des Valeurs mobilières | | \$ 2 167 937 | 89,05 |
| ÉTATS-UNIS | | | | Easy Tactic Ltd. (7,500 % en numéraire ou 7,500 % de rémunération en nature) | | | | ACTIONS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 7,500 % éch. 11/07/2025 (a) | 1 660 | 91 | 0,00 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| Cantor Fitzgerald LP 7,200 % éch. 12/12/2028 | 12 200 | 12 516 | 0,51 | 7,500 % éch. 11/07/2027 (a) | 53 941 | 2 647 | 0,11 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| Hyundai Capital America 5,950 % éch. 21/09/2026 | 13 100 | 13 329 | 0,55 | 7,500 % éch. 11/07/2028 (a) | 44 139 | 1 931 | 0,08 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e) | 19 787 095 | 197 171 | 8,10 |
| | | 25 845 | 1,06 | LS Finance Ltd. 4,800 % éch. 18/06/2026 | 800 | 608 | 0,03 | PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (e) | 744 048 | 10 117 | 0,41 |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % éch. 10/03/2028 (d) | 23 655 | 12 892 | 0,53 | | | 207 288 | 8,51 |
| Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051 | 2 700 | 1 708 | 0,07 | 4,800 % éch. 29/01/2024 (d) | 6 100 | 2 662 | 0,11 | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c) | | | | 5,250 % éch. 22/03/2026 (d) | 25 500 | 16 912 | 0,69 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e) | 48 700 | 4 856 | 0,20 |
| 0,125 % éch. 15/01/2032 | 50 613 | 44 480 | 1,83 | 6,150 % éch. 16/03/2025 (d) | 42 800 | 34 899 | 1,43 | Total des Fonds d'investissement | | \$ 212 144 | 8,71 |
| | | 46 188 | 1,90 | NWD MTN Ltd. 4,125 % éch. 18/07/2029 | 891 | 679 | 0,03 | | | | |
| Total États-Unis | | 72 033 | 2,96 | Peak RE BVI Holding Ltd. 5,350 % éch. 28/10/2025 (d) | 8 670 | 7 287 | 0,30 | | | | |
| VIETNAM | | | | RKPF Overseas Ltd. 5,125 % éch. 26/07/2026 | 16 550 | 3 907 | 0,16 | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,200 % éch. 12/01/2026 | 25 100 | 6 549 | 0,27 | | | | |
| Vietnam Debt & Asset Trading Corp. 1,000 % éch. 10/10/2025 | 1 300 | 1 144 | 0,05 | Studio City Co. Ltd. 7,000 % éch. 15/02/2027 | 9 630 | 9 483 | 0,39 | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement vietnamien 5,500 % éch. 12/03/2028 | 912 | 879 | 0,03 | Studio City Finance Ltd. 5,000 % éch. 15/01/2029 | 11 600 | 9 761 | 0,40 | | | | |
| Total Vietnam | | 2 023 | 0,08 | 6,000 % éch. 15/07/2025 | 18 351 | 17 982 | 0,74 | | | | |
| | | | | 6,500 % éch. 15/01/2028 | 5 267 | 4 892 | 0,20 | | | | |
| | | | | Total Îles Vierges britanniques | | 180 266 | 7,40 | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---|---------------------|--|--|------------------------|
| SSB | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 3 856 | Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 31/07/2025 | \$ (3 933) | \$ 3 856 | \$ 3 857 | 0,16 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (3 933) | \$ 3 856 | \$ 3 857 | 0,16 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|------|----------------------|---------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 3 002 | \$ 6 690 | 0,27 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 313 | 200 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 132 | 738 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 578 | 5 086 | 0,21 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 23 | 281 | 0,01 |
| | | | | \$ 12 995 | 0,53 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 12 995 | 0,53 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 % | 20/06/2026 | € 2 800 | \$ 61 | 0,00 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20/06/2028 | 5 000 | 200 | 0,01 |
| | | | | \$ 261 | 0,01 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice iTraxx Asia Ex-Japan 40 Index à 5 ans | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 16 100 | \$ (155) | (0,01) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|---------------------|
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 % | 16/06/2031 | \$ 19 400 | \$ (550) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/12/2026 | 37 550 | (366) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/06/2032 | 25 700 | (57) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2031 | 2 400 | (15) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/12/2051 | 39 300 | (2 054) | (0,08) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 20/12/2024 | 118 200 | 84 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,603 | 18/06/2029 | 90 100 | (1 313) | (0,05) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 31 200 | 311 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2029 | AUD 105 500 | (1 918) | (0,08) |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | 105 500 | 3 509 | 0,14 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | € 15 500 | (502) | (0,02) |
| | | | | | \$ (2 871) | (0,11) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (2 765) | (0,11) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|---|--------------|---------------------|
| BPS | Longfor Group Holdings Ltd. | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 9 500 | \$ (155) | \$ (2 670) | \$ (2 825) | (0,12) |
| BRC | BOC Aviation Ltd. | 1,000 | 20/06/2026 | 24 300 | (70) | 318 | 248 | 0,01 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement vietnamien | 1,000 | 20/12/2027 | 9 100 | (263) | 257 | (6) | 0,00 |
| | | | | | \$ (488) | \$ (2 095) | \$ (2 583) | (0,11) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|--|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|---|--------------|---------------------|
| JPM | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,053 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | \$ 59 110 | PHP 3 285 920 | \$ (11) | \$ (597) | \$ (608) | (0,02) |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/03/2029 | MYR 241 500 | \$ 209 | \$ (4) | \$ 205 | 0,01 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 5 079 | \$ 3 363 | \$ 0 | \$ (103) | (0,01) | |
| BOA | 01/2024 | | 770 | 510 | 0 | (16) | 0,00 | |
| | 01/2024 | NZD | 320 | 195 | 0 | (8) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 5 016 | ¥ 740 234 | 238 | 0 | 0,01 | |
| | 02/2024 | CNY | 21 609 | \$ 3 058 | 2 | 2 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 31 638 | 4 370 | 0 | (98) | (0,01) | |
| | 03/2024 | MYR | 114 015 | 24 139 | 0 | (860) | (0,04) | |
| | 03/2024 | \$ | 81 | PHP 4 534 | 1 | 0 | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | | 1 137 | AUD 1 729 | 43 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 7 400 | € 6 821 | 137 | 0 | 0,01 | |
| | 02/2024 | CNY | 38 537 | \$ 5 429 | 0 | (20) | 0,00 | |
| | 02/2024 | TWD | 50 024 | 1 574 | 0 | (79) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 151 709 | 4 815 | 0 | (211) | (0,01) | |
| | 03/2024 | \$ | 1 065 | IDR 16 418 819 | 0 | (1) | 0,00 | |
| DUB | 03/2024 | CNH | 18 357 | \$ 2 548 | 0 | (45) | 0,00 | |
| | 03/2024 | SGD | 17 848 | 13 483 | 0 | (95) | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | \$ | 3 323 | ¥ 488 578 | 145 | 0 | 0,01 | |
| | 02/2024 | | 12 293 | TRY 376 655 | 0 | (123) | (0,01) | |
| | 03/2024 | CNH | 8 603 | \$ 1 192 | 0 | (23) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 7 179 | IDR 110 546 701 | 0 | (11) | 0,00 | |
| IND | 03/2024 | | 13 043 | CNH 93 636 | 183 | 0 | 0,01 | |
| JPM | 02/2024 | | 12 993 | INR 1 085 458 | 21 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | SGD | 118 | \$ 89 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 102 530 | 3 298 | 0 | (100) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 8 791 | IDR 135 730 054 | 10 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | AUD | 2 382 | \$ 1 580 | 0 | (46) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 12 077 | ¥ 1 747 600 | 327 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | HKD | 1 121 | \$ 144 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | PHP | 776 602 | 13 878 | 0 | (141) | (0,01) | |
| | 03/2024 | \$ | 10 724 | IDR 165 321 472 | 0 | (4) | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | € | 30 708 | \$ 33 753 | 0 | (177) | (0,01) | |
| | 01/2024 | £ | 1 | 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | SGD | 436 | 330 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 28 | € 26 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 158 | £ 124 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 2 923 | ¥ 430 773 | 135 | 0 | 0,01 | |
| | 02/2024 | CNY | 22 564 | \$ 3 187 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 18 849 | 2 614 | 0 | (49) | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 300 139 176 | 19 500 | 37 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 4 757 | IDR 73 163 236 | 0 | (12) | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | | 11 228 | MYR 52 446 | 217 | 0 | 0,01 | |
| | 02/2024 | | 1 158 | CNY 8 287 | 13 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 18 505 | \$ 2 556 | 0 | (58) | 0,00 | |
| | 03/2024 | HKD | 23 876 | 3 063 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 82 359 | 2 609 | 0 | (120) | (0,01) | |
| | 03/2024 | \$ | 938 | IDR 14 368 533 | 0 | (6) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 61 | THB 2 110 | 1 | 0 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | AUD | 1 926 | \$ 1 278 | 0 | (37) | 0,00 | |
| | | | | | \$ 1 510 | \$ (2 447) | \$ (937) | (0,04) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de distribution et Investisseurs en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 1 293 | AUD 1 950 | \$ 38 | \$ 0 | \$ 38 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 77 | 116 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD 22 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 | AUD 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 499 | 753 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 623 | 939 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | | | | \$ 73 | \$ 0 | \$ 73 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 31 | \$ 36 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | \$ 218 | CHF 190 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | CHF 95 | \$ 109 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 42 | CHF 37 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CHF 4 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 002 | CHF 1 754 | 84 | 0 | 84 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 2 011 | 1 755 | 76 | 0 | 76 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 9 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 1 767 | 1 542 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | | | | \$ 235 | \$ (4) | \$ 231 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 582 | \$ 633 | \$ 0 | \$ (10) | \$ (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 18 686 | € 17 080 | 186 | 0 | 186 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 134 747 | 122 522 | 628 | 0 | 628 | 0,03 |
| CBK | 01/2024 | € 260 | \$ 286 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 225 | € 208 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | € 20 428 | \$ 22 335 | 0 | (235) | (235) | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | 20 175 | 22 059 | 0 | (232) | (232) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 53 | € 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | € 101 | \$ 109 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 134 666 | € 122 522 | 709 | (1) | 708 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | 134 769 | 122 522 | 605 | 0 | 605 | 0,02 |
| | | | | \$ 2 134 | \$ (481) | \$ 1 653 | 0,07 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 4 | \$ 5 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 718 | £ 565 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 12 490 | 9 868 | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 394 | \$ 499 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ 3 | £ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 130 | \$ 165 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 32 | £ 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 13 | \$ 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 | £ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | £ 16 | \$ 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 12 838 | £ 10 174 | 132 | 0 | 132 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | £ 1 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 12 866 | £ 10 166 | 94 | 0 | 94 | 0,00 |
| | | | | \$ 320 | \$ (4) | \$ 316 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en RMB (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | \$ 148 | CNH 1 053 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CNH 2 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | \$ 72 | CNH 517 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 11 | 78 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | CNH 2 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 | CNH 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ | 6 420 | SGD | 8 565 | \$ 75 | 0,01 |
| DUB | 01/2024 | | 6 665 | | 8 859 | 53 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SGD | 19 | \$ | 14 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 232 | SGD | 1 644 | 15 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD | 191 | \$ | 143 | 0 | (2), 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 416 | SGD | 556 | 5 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 426 | | 561 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | | 6 217 | | 8 292 | 72 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD | 84 | \$ | 64 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ | 49 | SGD | 65 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 220 | (2), 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ (1 432) | (0,06) |
| Total des Investissements | | | | | | \$ 2 392 735 | 98,28 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | \$ 41 993 | 1,72 |
| Actifs nets | | | | | | \$ 2 434 728 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,04 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|-------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| Flourish Century | 6,600 % | 04/02/2022 | 25/08/2021 - 27/08/2021 | \$ 10 747 | \$ 998 | 0,04 |

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 13 246 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 630 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 24 631 \$ (31 décembre 2022 : 21 668 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 5 280 \$ (31 décembre 2022 : 12 646 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 2 166 143 | \$ 1 794 | \$ 2 167 937 |
| Fonds d'investissement | 207 288 | 4 856 | 0 | 212 144 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 3 856 | 0 | 3 856 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | 8 798 | 0 | 8 798 |
| Totaux | \$ 207 288 | \$ 2 183 653 | \$ 1 794 | \$ 2 392 735 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 2 650 199 | \$ 1 972 | \$ 2 652 171 |
| Fonds d'investissement | 235 155 | 4 824 | 0 | 239 979 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 20 572 | 0 | 20 572 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 413 | 27 752 | (1 299) | 26 866 |
| Totaux | \$ 235 568 | \$ 2 703 347 | \$ 673 | \$ 2 939 588 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 4,700 % | 28/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (3 947) | \$ (3 996) | (0,16) |
| | 4,750 | 28/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (8 844) | (8 955) | (0,37) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (12 951) | (0,53) |

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (65) | \$ 0 | \$ (65) | \$ 1 734 | \$ (1 360) | \$ 374 |
| BOA | (661) | 350 | (311) | (199) | 350 | 151 |
| BPS | (2 780) | 2 630 | (150) | (8 680) | 9 734 | 1 054 |
| BRC | 975 | (1 700) | (725) | (872) | 1 172 | 300 |
| CBK | (8) | 0 | (8) | 4 080 | (4 046) | 34 |
| DUB | (322) | 440 | 118 | 1 048 | (1 010) | 38 |
| GLM | 87 | 0 | 87 | 96 | 0 | 96 |
| GST | 205 | 0 | 205 | (732) | 660 | (72) |
| IND | 183 | 0 | 183 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (678) | 850 | 172 | (538) | 730 | 192 |
| MBC | (78) | 260 | 182 | 4 627 | (4 030) | 597 |
| MYI | 785 | (1 300) | (515) | 479 | (240) | 239 |
| SCX | 47 | 10 | 57 | 4 720 | (4 520) | 200 |
| SSB | 132 | (220) | (88) | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 746 | 740 | 1 486 | 7 636 | (8 540) | (904) |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 75,37 | 70,88 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 13,68 | 18,07 |
| Fonds d'investissement | 8,71 | 8,05 |
| Contrats de mise en pension | 0,16 | 0,69 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,53 | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,11) | 0,47 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,06) | 0,45 |
| Contrats de prise en pension | (0,53) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Australie | 0,81 | 1,12 |
| Brésil | 0,30 | 0,13 |
| Îles Caïmans | 18,21 | 26,52 |
| Chine | 1,95 | 1,91 |
| Colombie | 0,27 | S/O |
| France | 0,75 | 0,59 |
| Allemagne | S/O | 0,38 |
| Hong Kong | 8,29 | 6,10 |
| Inde | 8,17 | 6,45 |
| Indonésie | 3,76 | 3,84 |
| Israël | S/O | 0,09 |
| Italie | 0,28 | S/O |
| Japon | S/O | 0,24 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,63 | 0,84 |
| Luxembourg | S/O | 0,13 |
| République du Mali | 0,29 | S/O |
| Île Maurice | 6,77 | 7,22 |
| Mexique | 0,30 | 0,37 |
| Mongolie | 1,87 | 1,30 |
| Pays-Bas | 1,48 | 1,80 |
| Oman | 0,20 | 0,16 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Pakistan | 4,06 | 2,18 |
| Philippines | 3,62 | 3,53 |
| Singapour | 3,36 | 3,90 |
| Afrique du Sud | 0,26 | S/O |
| Corée du Sud | 0,91 | 0,20 |
| Sri Lanka | 4,11 | 1,91 |
| Thaïlande | 2,45 | 2,75 |
| Turquie | 0,26 | S/O |
| Royaume-Uni | 5,25 | 3,67 |
| États-Unis | 2,96 | 1,57 |
| Vietnam | 0,08 | 0,21 |
| Îles Vierges britanniques | 7,40 | 9,83 |
| Instruments à court terme | 0,00 | 0,01 |
| Fonds d'investissement | 8,71 | 8,05 |
| Contrats de mise en pension | 0,16 | 0,69 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,53 | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,01) | S/O |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,03 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,11) | 0,45 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | (0,09) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,11) | (0,07) |
| Swaps sur devises croisées | (0,02) | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | S/O |
| Contrats de change à terme | (0,04) | 0,06 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,10 | 0,55 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 1,72 | 1,40 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| RELIANCE INDUSTRIES LTD. | | | | JERSEY, ÎLES ANGLONORMANDES | | | | PHILIPPINES | | | |
| 2,875 % éch. 12/01/2032 | \$ 400 | \$ 343 | 0,19 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| RENEW POWER PVT LTD. | | | | West China Cement Ltd. | | | | San Miguel Corp. | | | |
| 5,875 % éch. 05/03/2027 | 600 | 574 | 0,32 | 4,950 % éch. 08/07/2026 | \$ 1 100 | \$ 804 | 0,45 | 5,500 % éch. 29/07/2025 (c) | \$ 500 | \$ 465 | 0,26 |
| SHRIRAM FINANCE LTD. | | | | LUXEMBOURG | | | | SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP. | | | |
| 4,150 % éch. 18/07/2025 | 958 | 918 | 0,52 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 7,000 % éch. 21/10/2025 (c) | 200 | 179 | 0,10 |
| 4,400 % éch. 13/03/2024 | 1 080 | 1 073 | 0,61 | Guara Norte SARL | | | | | | | |
| ULTRATECH CEMENT LTD. | | | | 5,198 % éch. 15/06/2034 | 514 | 469 | 0,26 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 2,800 % éch. 16/02/2031 | 1 400 | 1 186 | 0,67 | MALAISIE | | | | Obligation internationale du gouvernement philippin | | | |
| Total Inde | | 12 825 | 7,24 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,200 % éch. 06/07/2046 | 900 | 700 | 0,40 |
| INDONÉSIE | | | | Khazanah Capital Ltd. | | | | 5,000 % éch. 17/07/2033 | 400 | 411 | 0,23 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,876 % éch. 01/06/2033 | 300 | 302 | 0,17 | 5,000 % éch. 13/01/2037 | 200 | 206 | 0,12 |
| BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | | | | Khazanah Global Sukuk Bhd. | | | | 5,609 % éch. 13/04/2033 | 600 | 642 | 0,36 |
| 5,500 % éch. 04/04/2026 | 800 | 803 | 0,45 | 4,687 % éch. 01/06/2028 | 700 | 703 | 0,40 | | | | |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT | | | | Misc Capital Two Labuan Ltd. | | | | | | | |
| 3,750 % éch. 30/03/2026 (e) | 1 020 | 975 | 0,55 | 3,625 % éch. 06/04/2025 | 2 600 | 2 543 | 1,44 | | | | |
| 4,300 % éch. 24/03/2027 (c)(e) | 1 250 | 1 111 | 0,63 | Petronas Capital Ltd. | | | | Total Philippines | | 2 603 | 1,47 |
| BUKIT MAKMUR MANDIRI UTAMA PT | | | | 2,480 % éch. 28/01/2032 | 400 | 342 | 0,19 | SINGAPOUR | | | |
| 7,750 % éch. 10/02/2026 | 700 | 667 | 0,38 | 3,404 % éch. 28/04/2061 | 550 | 396 | 0,22 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| CIKARANG LISTRINDO TBK PT | | | | | | | | BOC AVIATION LTD. | | | |
| 4,950 % éch. 14/09/2026 | 200 | 192 | 0,11 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 3,500 % éch. 10/10/2024 | 1 000 | 986 | 0,56 |
| FREEPORT INDONESIA PT | | | | Export-Import Bank of Malaysia Bhd. | | | | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. | | | |
| 4,763 % éch. 14/04/2027 | 700 | 691 | 0,39 | 1,831 % éch. 26/11/2026 | 700 | 640 | 0,36 | 4,250 % éch. 25/03/2027 | 450 | 412 | 0,23 |
| 5,315 % éch. 14/04/2032 | 800 | 787 | 0,44 | Total Malaisie | | 4 926 | 2,78 | GLP Pte. Ltd. | | | |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT | | | | ÎLE MAURICE | | | | 3,875 % éch. 04/06/2025 | 500 | 332 | 0,19 |
| 3,541 % éch. 27/04/2032 | 500 | 433 | 0,24 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | INDIKA ENERGY CAPITAL PTE. LTD. | | | |
| INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PT | | | | CA Magnum Holdings | | | | 8,250 % éch. 22/10/2025 | 350 | 352 | 0,20 |
| 5,800 % éch. 15/05/2050 | 800 | 778 | 0,44 | 5,375 % éch. 31/10/2026 | 1 600 | 1 492 | 0,84 | MEDCO BELL PTE. LTD. | | | |
| LLPL CAPITAL PTE. LTD. | | | | Greenko Dutch BV | | | | 6,375 % éch. 30/01/2027 | 478 | 455 | 0,26 |
| 6,875 % éch. 04/02/2039 | 644 | 621 | 0,35 | 3,850 % éch. 29/03/2026 | 1 665 | 1 554 | 0,88 | MEDCO MAPLE TREE PTE LTD. | | | |
| MINEJESA CAPITAL BV | | | | India Cleantech Energy | | | | 8,960 % éch. 27/04/2029 | 400 | 407 | 0,23 |
| 4,625 % éch. 10/08/2030 | 200 | 190 | 0,11 | 4,700 % éch. 10/08/2026 | 1 238 | 1 129 | 0,64 | MEDCO OAK TREE PTE. LTD. | | | |
| PAKUWON JATI TBK PT | | | | India Green Energy Holdings | | | | 7,375 % éch. 14/05/2026 | 768 | 763 | 0,43 |
| 4,875 % éch. 29/04/2028 | 200 | 186 | 0,11 | 5,375 % éch. 29/04/2024 | 1 800 | 1 782 | 1,00 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP. LTD. | | | |
| PERTAMINA PERSERO PT | | | | India Toll Roads | | | | 4,602 % éch. 15/06/2032 (e) | 1 800 | 1 779 | 1,00 |
| 4,175 % éch. 21/01/2050 | 1 200 | 1 004 | 0,57 | 5,500 % éch. 19/08/2024 | 1 300 | 1 279 | 0,72 | UNITED OVERSEAS BANK LTD. | | | |
| 6,450 % éch. 30/05/2044 | 200 | 220 | 0,12 | Total Île Maurice | | 7 236 | 4,08 | 1,750 % éch. 16/03/2031 (e) | 500 | 462 | 0,26 |
| PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA | | | | MEXIQUE | | | | Total Singapour | | 5 948 | 3,36 |
| 6,150 % éch. 21/05/2048 | 400 | 411 | 0,23 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | CORÉE DU SUD | | | |
| SAKA ENERGI INDONESIA PT | | | | GS Caltex Corp. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 4,450 % éch. 05/05/2024 | 233 | 231 | 0,13 | 5,375 % éch. 07/08/2028 | 1 100 | 1 112 | 0,63 | GS Caltex Corp. | | | |
| | | 9 300 | 5,25 | Hana Bank | | | | 3,250 % éch. 30/03/2027 | 1 000 | 956 | 0,54 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | KB Capital Co. Ltd. | | | | 1,500 % éch. 28/10/2025 | 500 | 463 | 0,26 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien | | | | Kodit Global Co. Ltd. | | | | 4,954 % éch. 25/05/2026 | 1 000 | 998 | 0,56 |
| 5,250 % éch. 17/01/2042 | 900 | 940 | 0,53 | Kookmin Bank | | | | POSCO | | | |
| 5,450 % éch. 20/09/2052 | 600 | 644 | 0,36 | 2,500 % éch. 04/11/2030 (e) | 900 | 750 | 0,42 | 5,750 % éch. 17/01/2028 | 2 400 | 2 464 | 1,39 |
| | | 1 584 | 0,89 | Total Mongolie | | 1 187 | 0,67 | Shinhan Bank Co. Ltd. | | | |
| Total Indonésie | | 10 884 | 6,14 | MONGOLIE | | | | 4,000 % éch. 23/04/2029 (e) | 200 | 187 | 0,11 |
| IRLANDE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Shinhan Card Co. Ltd. | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Obligation internationale du gouvernement mongol | | | | 2,500 % éch. 27/01/2027 | 2 200 | 2 031 | 1,15 |
| AERCAP IRELAND CAPITAL DAC | | | | 4,450 % éch. 07/07/2031 | 1 000 | 841 | 0,47 | SK Hynix, Inc. | | | |
| 6,100 % éch. 15/01/2027 | 150 | 153 | 0,09 | 8,650 % éch. 19/01/2028 | 330 | 346 | 0,20 | 1,500 % éch. 19/01/2026 | 200 | 184 | 0,10 |
| SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC | | | | Total Pays-Bas | | 1 720 | 0,97 | 2,375 % éch. 19/01/2031 | 1 720 | 1 396 | 0,79 |
| 5,450 % éch. 03/05/2028 | 2 100 | 2 114 | 1,19 | PAKISTAN | | | | Tongyang Life Insurance Co. Ltd. | | | |
| Total Irlande | | 2 267 | 1,28 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,250 % éch. 22/09/2025 (c) | 1 100 | 1 012 | 0,57 |
| ITALIE | | | | Obligation internationale du gouvernement pakistanais | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,000 % éch. 08/04/2026 | 2 950 | 2 091 | 1,18 | Korea Electric Power Corp. | | | |
| NEXI SPA | | | | 6,875 % éch. 05/12/2027 | 1 400 | 961 | 0,54 | 5,375 % éch. 06/04/2026 | 2 000 | 2 020 | 1,14 |
| 2,125 % éch. 30/04/2029 | € 500 | 489 | 0,28 | 8,250 % éch. 30/09/2025 | 200 | 171 | 0,10 | Korea Land & Housing Corp. | | | |
| JAPON | | | | Total Pakistan | | 3 223 | 1,82 | 5,750 % éch. 06/10/2025 | 1 000 | 1 012 | 0,57 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | PAKISTAN | | | | Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp. | | | |
| MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP, INC. | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,375 % éch. 11/05/2028 | 1 450 | 1 466 | 0,83 |
| 5,063 % éch. 12/09/2025 | \$ 1 700 | 1 694 | 0,96 | Obligation internationale du gouvernement pakistanais | | | | Korea National Oil Corp. | | | |
| SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD. | | | | 6,000 % éch. 08/04/2026 | 2 950 | 2 091 | 1,18 | 4,875 % éch. 03/04/2028 | 600 | 604 | 0,34 |
| 4,800 % éch. 15/09/2025 | 1 900 | 1 888 | 1,06 | 6,875 % éch. 05/12/2027 | 1 400 | 961 | 0,54 | | | | |
| Total Japon | | 3 582 | 2,02 | 8,250 % éch. 30/09/2025 | 200 | 171 | 0,10 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,250 % éch. 14/11/2026 | \$ 2 200 | \$ 2 221 | 1,25 | Standard Chartered PLC | \$ 800 | \$ 799 | 0,45 | ÎLES VIERGES BRITANNIQUES | | | |
| | | 7 323 | 4,13 | 0,991 % éch. 12/01/2025 | 1 400 | 1 349 | 0,76 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Total Corée du Sud | | 18 876 | 10,65 | 1,822 % éch. 23/11/2025 | 500 | 415 | 0,23 | Celestial Miles Ltd. | \$ 700 | \$ 699 | 0,40 |
| SRI LANKA | | | | 3,603 % éch. 12/01/2033 (f) | 1 000 | 983 | 0,56 | 5,750 % éch. 31/01/2024 (c) | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 6,000 % éch. 26/07/2025 (c)(e) | 1 500 | 1 524 | 0,86 | Champion Path Holdings Ltd. | 600 | 560 | 0,32 |
| Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka | | | | 6,170 % éch. 09/01/2027 | 500 | 508 | 0,29 | 4,500 % éch. 27/01/2026 | | | |
| 5,750 % éch. 18/04/2023 ^ | 500 | 257 | 0,14 | 6,187 % éch. 06/07/2027 | 800 | 819 | 0,46 | Easy Tactic Ltd. (7,500 % en numéraire ou 7,500 % de rémunération en nature) | | | |
| 6,200 % éch. 11/05/2027 ^ | 1 100 | 559 | 0,32 | 7,750 % éch. 15/08/2027 (c)(e) | 650 | 484 | 0,27 | 7,500 % éch. 11/07/2027 (a) | 726 | 36 | 0,02 |
| 6,350 % éch. 28/06/2024 ^ | 500 | 255 | 0,14 | Vedanta Resources Finance PLC | | | | 7,500 % éch. 11/07/2028 (a) | 1 828 | 80 | 0,05 |
| 6,825 % éch. 18/07/2026 ^ | 500 | 257 | 0,14 | 8,950 % éch. 11/03/2025 | | | | NWD Finance BVI Ltd. | | | |
| 6,850 % éch. 14/03/2024 ^ | 800 | 407 | 0,23 | Total Royaume-Uni | | 7 734 | 4,36 | 4,125 % éch. 10/03/2028 (c) | 850 | 463 | 0,26 |
| 7,850 % éch. 14/03/2029 ^ | 900 | 455 | 0,26 | ÉTATS-UNIS | | | | 4,800 % éch. 29/01/2024 (c) | 400 | 174 | 0,10 |
| Total Sri Lanka | | 2 190 | 1,23 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,250 % éch. 22/03/2026 (c) | 1 000 | 663 | 0,37 |
| THAÏLANDE | | | | Cantor Fitzgerald LP | 800 | 821 | 0,46 | Peak RE BVI Holding Ltd. | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 7,200 % éch. 12/12/2028 | | | | 5,350 % éch. 28/10/2025 (c) | 800 | 672 | 0,38 |
| Bangkok Bank PCL | | | | Goldman Sachs Group, Inc. | 100 | 98 | 0,06 | RKPF Overseas Ltd. | 1 300 | 307 | 0,17 |
| 4,300 % éch. 15/06/2027 | 600 | 588 | 0,33 | 3,272 % éch. 29/09/2025 | | | | 5,125 % éch. 26/07/2026 | | | |
| 5,300 % éch. 21/09/2028 | 1 150 | 1 169 | 0,66 | Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. | 400 | 404 | 0,23 | Studio City Finance Ltd. | | | |
| | | | | 5,000 % éch. 27/07/2028 | | | | 5,000 % éch. 15/01/2029 | 1 100 | 926 | 0,52 |
| | | | | Hyundai Capital America | 500 | 467 | 0,26 | 6,000 % éch. 15/07/2025 | 400 | 392 | 0,22 |
| 5,275 % éch. 14/10/2025 (c)(e) | 1 100 | 1 055 | 0,59 | 5,950 % éch. 21/09/2026 | 1 600 | 1 628 | 0,92 | Total Îles Vierges britanniques | | 4 972 | 2,81 |
| 5,458 % éch. 07/03/2028 | 1 400 | 1 428 | 0,81 | Wells Fargo & Co. | | | | Total des Valeurs mobilières | \$ 160 430 | 90,53 | |
| Total Thaïlande | | 4 240 | 2,39 | 2,406 % éch. 30/10/2025 | 100 | 97 | 0,05 | ACTIONS | | | |
| TURQUIE | | | | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Billets du Trésor américain | 3 400 | 3 360 | 1,90 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği A/S | | | | 3,250 % éch. 31/08/2024 | | | | PIMCO Select Funds plc - | | | |
| 8,250 % éch. 15/11/2028 | 400 | 418 | 0,24 | Total États-Unis | | 6 875 | 3,88 | Fonds PIMCO | | | |
| ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | VIETNAM | | | | PIMCO Specialty Funds | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Vietnam Debt & Asset Trading Corp. | 1 000 | 880 | 0,50 | Ireland p.l.c. - Fonds | | | |
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. | | | | 1,000 % éch. 10/10/2025 | | | | PIMCO China Bond | 1 880 | 26 | 0,01 |
| 4,875 % éch. 25/07/2033 | 800 | 794 | 0,45 | Obligation internationale du gouvernement vietnamien | | | | Fund (d) | | 10 564 | 5,96 |
| ROYAUME-UNI | | | | 5,500 % éch. 12/03/2028 | 1 900 | 1 831 | 1,03 | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Total Vietnam | | 2 711 | 1,53 | PIMCO ETFs plc - Fonds | | | |
| HSBC Holdings PLC | | | | | | | | PIMCO US Dollar Short | | | |
| 8,000 % éch. 07/03/2028 (c)(e) | 400 | 413 | 0,23 | | | | | Maturity UCITS ETF (d) | 10 100 | 1 007 | 0,57 |
| Prudential Funding Asia PLC | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement | \$ 11 571 | 6,53 | |
| 2,950 % éch. 03/11/2033 | 500 | 440 | 0,25 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garantie par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| SSB | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 252 | Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 31/10/2025 | \$ (257) | \$ 252 | \$ 252 | 0,14 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (257) | \$ 252 | \$ 252 | 0,14 |

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)**

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 6 | \$ (6) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 19 | 18 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 75 | 130 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 19 | 47 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 40 | 187 | 0,11 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 23 | 116 | 0,06 |
| | | | | \$ 492 | 0,28 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 492 | 0,28 |

Tableau des investissements Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Atlantia SpA | 1,000 % | 20/06/2025 | € 100 | \$ 1 | 0,00 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20/06/2026 | 100 | 2 | 0,00 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20/06/2028 | 400 | 17 | 0,01 |
| | | | | \$ 20 | 0,01 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice iTraxx Asia Ex-Japan 40 Index à 5 ans | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 3 900 | \$ (44) | (0,02) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 % | 15/06/2024 | \$ 4 200 | \$ (84) | (0,05) |
| À payer | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,125 | 16/05/2024 | CNY 50 000 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 0,500 | 16/12/2025 | AUD 800 | (5) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2029 | 6 200 | (148) | (0,08) |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | 6 200 | 258 | 0,14 |
| | | | | | \$ 22 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (2) | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽³⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽⁴⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS | Longfor Group Holdings Ltd. | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 600 | \$ (10) | \$ (168) | \$ (178) | (0,11) |
| BRC | BOC Aviation Ltd. | 1,000 | 20/06/2026 | 1 300 | (5) | 18 | 13 | 0,01 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2028 | 5 700 | 0 | 77 | 77 | 0,04 |
| | Obligation internationale du gouvernement philippin | 1,000 | 20/12/2028 | 1 400 | 6 | 18 | 24 | 0,02 |
| | | | | | \$ (9) | \$ (55) | \$ (64) | (0,04) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|---|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| JPM | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,053 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | \$ 4 571 | PHP 254 080 | \$ (1) | \$ (46) | \$ (47) | (0,03) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | À recevoir ⁽¹⁾ | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/03/2029 | MYR 22 260 | \$ 20 | \$ (1) | \$ 19 | 0,01 |

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 1 142 | \$ 756 | \$ 0 | \$ (23) | (0,01) | |
| | 03/2024 | \$ | 101 | CNH 727 | 2 | 2 | 0,00 | |
| BOA | 01/2024 | AUD | 606 | \$ 401 | 0 | (13) | (0,01) | |
| | 02/2024 | CNY | 1 874 | 265 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 117 | CNY 837 | 2 | 2 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 769 | \$ 106 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 03/2024 | MYR | 8 636 | 1 828 | 0 | (66) | (0,04) | |
| | 03/2024 | \$ | 128 | INR 10 689 | 0 | 0 | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | | 4 619 | € 4 238 | 65 | 65 | 0,04 | |
| | 01/2024 | | 4 | HKD 29 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 843 | ¥ 124 100 | 38 | 38 | 0,02 | |
| | 02/2024 | CNY | 3 343 | \$ 471 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 02/2024 | TWD | 7 022 | 221 | 0 | (11) | (0,01) | |
| | 03/2024 | | 5 813 | 185 | 0 | (8) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 444 | INR 37 129 | 1 | 1 | 0,00 | |
| BRC | 03/2024 | HKD | 1 123 | \$ 144 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 5 | THB 166 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 697 | TRY 21 833 | 0 | (9) | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 125 | 4 034 | 0 | (2) | 0,00 | |
| CBK | 02/2024 | | 62 | CNY 448 | 1 | 1 | 0,00 | |
| DUB | 03/2024 | SGD | 1 337 | \$ 1 010 | 0 | (7) | 0,00 | |
| GLM | 03/2024 | \$ | 87 | TRY 2 724 | 0 | (1) | 0,00 | |
| IND | 03/2024 | | 462 | CNH 3 317 | 6 | 6 | 0,01 | |
| JPM | 03/2024 | CNH | 1 263 | \$ 175 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 03/2024 | SGD | 218 | 164 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 13 843 | 445 | 0 | (13) | (0,01) | |
| | 03/2024 | \$ | 522 | IDR 8 056 132 | 1 | 1 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 133 | INR 11 129 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | AUD | 535 | \$ 355 | 0 | (10) | (0,01) | |
| | 01/2024 | € | 3 363 | 3 677 | 0 | (40) | (0,02) | |
| | 01/2024 | \$ | 863 | ¥ 124 900 | 23 | 23 | 0,01 | |
| | 03/2024 | PHP | 57 310 | \$ 1 024 | 0 | (10) | (0,01) | |
| | 03/2024 | \$ | 637 | IDR 9 812 494 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | € | 2 572 | \$ 2 828 | 1 | (14) | (0,01) | |
| | 01/2024 | SGD | 866 | 656 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 8 | € 7 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | CNY | 1 957 | \$ 276 | 0 | 0 | 0,00 | |
| SCX | 03/2024 | CNH | 810 | 112 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 11 | € 10 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 893 | MYR 4 169 | 17 | 17 | 0,01 | |
| | 02/2024 | | 522 | CNY 3 736 | 6 | 6 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 796 | \$ 110 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 290 | INR 24 228 | 0 | 0 | 0,00 | |
| SOG | 03/2024 | HKD | 107 | \$ 14 | 0 | 0 | 0,00 | |
| SSB | 03/2024 | IDR | 2 474 567 | 161 | 0 | 0 | 0,00 | |
| TOR | 03/2024 | CNH | 488 | 68 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | | | | | \$ 163 | \$ (242) | \$ (79) | (0,04) |

Tableau des investissements Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 1 836 | € 1 677 | \$ 17 | \$ 0 | \$ 17 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | € 10 | \$ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 12 | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 234 | € 4 777 | 44 | 0 | 44 | 0,03 |
| MYI | 01/2024 | 2 938 | 2 673 | 15 | 0 | 15 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | € 52 | \$ 57 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 471 | € 5 027 | 84 | 0 | 84 | 0,05 |
| SSB | 01/2024 | 175 | 158 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 2 646 | 2 405 | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| | | | | \$ 172 | \$ (1) | \$ 171 | 0,11 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 8 | £ 7 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 1 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 14 | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 18 | £ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 151 | 120 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 127 | 100 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 151 | 119 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 4 | \$ 0 | \$ 4 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution et E en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 3 646 | SGD 4 863 | \$ 41 | \$ 0 | \$ 41 | 0,02 |
| BOA | 01/2024 | 3 957 | 5 280 | 46 | 0 | 46 | 0,03 |
| GLM | 01/2024 | 986 | 1 317 | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| MBC | 01/2024 | 668 | 891 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 02/2024 | 627 | 826 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 3 630 | 4 842 | 42 | 0 | 42 | 0,02 |
| | 02/2024 | 28 | 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 78 | 103 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 150 | \$ (1) | \$ 149 | 0,08 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 153 0,09

Total des Investissements

\$ 172 896 97,57

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 4 312 2,43

Actifs nets

\$ 177 208 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,06 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|-------------------------|----------|--------------|---------------------|
| Flourish Century | 6,600 % | 04/02/2022 | 25/08/2021 - 27/08/2021 | \$ 1 676 | \$ 156 | 0,09 |
| Standard Chartered PLC | 3,603 | 12/01/2033 | 06/02/2023 | 435 | 415 | 0,23 |
| | | | | \$ 2 111 | \$ 571 | 0,32 |

(g) Un titre d'une juste valeur globale de 546 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 422 \$ (31 décembre 2022 : 1 987 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 320 \$ (31 décembre 2022 : 30 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 159 876 | \$ 554 | \$ 160 430 |
| Fonds d'investissement | 10 564 | 1 007 | 0 | 11 571 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 252 | 0 | 252 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (6) | 649 | 0 | 643 |
| Totaux | \$ 10 558 | \$ 161 784 | \$ 554 | \$ 172 896 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 276 388 | \$ 571 | \$ 276 959 |
| Fonds d'investissement | 28 745 | 1 001 | 0 | 29 746 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 820 | 0 | 820 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 160 | 2 557 | (82) | 2 635 |
| Totaux | \$ 28 905 | \$ 280 766 | \$ 489 | \$ 310 160 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 4,300 % | 22/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (503) | \$ (505) | (0,28) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (505) | (0,28) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 37 | \$ 0 | \$ 37 | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | (34) | 0 | (34) | (103) | 0 | (103) |
| BPS | (95) | 270 | 175 | (80) | 0 | (80) |
| BRC | 2 | 0 | 2 | (20) | 30 | 10 |
| CBK | 1 | 0 | 1 | 917 | (820) | 97 |
| DUB | (7) | 0 | (7) | 77 | 0 | 77 |
| GLM | 11 | 0 | 11 | 61 | (250) | (189) |
| GST | 120 | 0 | 120 | S/O | S/O | S/O |
| IND | 6 | 0 | 6 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (63) | 0 | (63) | 34 | 0 | 34 |
| MBC | 14 | 0 | 14 | 661 | (670) | (9) |
| MYI | 42 | 50 | 92 | 10 | (129) | (119) |
| SCX | 105 | 0 | 105 | 894 | (680) | 214 |
| SSB | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 14 | 0 | 14 | 2 | 0 | 2 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 77,00 | 75,24 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 13,53 | 12,97 |
| Fonds d'investissement | 6,53 | 9,47 |
| Contrats de mise en pension | 0,14 | 0,26 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,28 | (0,05) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,00 | 0,11 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,09 | 0,78 |
| Contrats de prise en pension | (0,28) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Australie | 2,72 | 2,17 |
| Brésil | 0,33 | 0,10 |
| Îles Caïmans | 14,34 | 17,23 |
| Chine | 3,87 | 4,71 |
| France | 0,70 | 0,56 |
| Allemagne | S/O | 0,68 |
| Hong Kong | 7,76 | 5,57 |
| Inde | 7,24 | 7,64 |
| Indonésie | 6,14 | 9,42 |
| Irlande | 1,28 | S/O |
| Israël | S/O | 0,15 |
| Italie | 0,28 | S/O |
| Japon | 2,02 | 2,19 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,45 | 0,38 |
| Luxembourg | 0,26 | 0,22 |
| Malaisie | 2,78 | 2,11 |
| Île Maurice | 4,08 | 4,60 |
| Mexique | 0,45 | 0,24 |
| Mongolie | 0,67 | 0,53 |
| Pays-Bas | 0,97 | 1,40 |
| Pakistan | 1,82 | 0,87 |
| Philippines | 1,47 | 1,62 |
| Singapour | 3,36 | 3,04 |
| Corée du Sud | 10,65 | 7,62 |
| Sri Lanka | 1,23 | 0,70 |
| Thaïlande | 2,39 | 2,83 |
| Turquie | 0,24 | S/O |
| Émirats arabes unis | 0,45 | S/O |
| Royaume-Uni | 4,36 | 1,74 |
| États-Unis | 3,88 | 4,01 |
| Vietnam | 1,53 | S/O |
| Îles Vierges britanniques | 2,81 | 5,88 |
| Fonds d'investissement | 6,53 | 9,47 |
| Contrats de mise en pension | 0,14 | 0,26 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,28 | (0,05) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | (0,02) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,02) | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | 0,13 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | (0,04) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,04) | (0,04) |
| Swaps sur devises croisées | (0,03) | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | S/O |
| Contrats de change à terme | (0,04) | 0,03 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,19 | 0,83 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 2,43 | 1,22 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | | | | | | | | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027 | \$ | 216 | 0,03 | Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % éch. 30/09/2032 | \$ | 52 | 0,00 | 6,270 % éch. 25/01/2045 | \$ | 539 | 0,07 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % éch. 02/03/2026 | € | 2 000 | 0,34 | | | 4 | 0,00 | 6,390 % éch. 25/10/2044 | \$ | 86 | 0,01 |
| Banco Santander S.A. 6,938 % éch. 07/11/2033 | \$ | 1 200 | 0,20 | | | 933 | 0,14 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 6,000 % éch. 25/07/2036 | | 456 | 0,05 |
| Bank of America Corp. 5,875 % éch. 15/03/2028 (h) | | 602 | 0,09 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | | | 305 | 0,05 |
| Barclays PLC 4,972 % éch. 16/05/2029 | | 800 | 0,12 | Fannie Mae 1,128 % éch. 25/03/2036 (a) | | 107 | 0,00 | | | 12 381 | 1,85 |
| BPCE S.A. 7,003 % éch. 19/10/2034 | | 2 000 | 0,32 | Freddie Mac 0,000 % éch. 15/05/2035 | | 169 | 0,03 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Ford Motor Credit Co. LLC 3,810 % éch. 09/01/2024 | | 200 | 0,03 | 0,647 % éch. 15/08/2043 (a) | | 306 | 0,01 | Aames Mortgage Investment Trust 5,950 % éch. 25/04/2036 | | 80 | 0,01 |
| 5,584 % éch. 18/03/2024 | | 600 | 0,09 | Ginnie Mae 6,238 % éch. 20/09/2071 | | 6 331 | 0,94 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,950 % éch. 25/06/2036 | | 260 | 0,03 |
| HSBC Holdings PLC 6,254 % éch. 09/03/2034 | | 1 800 | 0,29 | 6,246 % éch. 20/08/2068 | | 771 | 0,11 | 6,370 % éch. 25/08/2035 | | 249 | 0,04 |
| JPMorgan Chase & Co. 2,522 % éch. 22/04/2031 | | 1 200 | 0,15 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | | 6,595 % éch. 25/05/2035 | | 157 | 0,02 |
| Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % éch. 30/06/2024 ^ | | 650 | 0,00 | 4,000 % éch. 01/11/2053 | | 2 800 | 0,40 | Aegis Asset-Backed Securities Trust 6,115 % éch. 25/12/2035 | | 433 | 0,06 |
| 9,750 % éch. 28/09/2023 ^ | | 1 100 | 0,01 | 6,000 % éch. 01/10/2053 | | 9 300 | 1,41 | Apidos CLO 6,594 % éch. 17/07/2030 | | 257 | 0,04 |
| 11,700 % éch. 11/11/2025 ^ | | 250 | 0,00 | 6,500 % éch. 01/11/2053 | | 17 400 | 2,66 | 6,687 % éch. 20/04/2031 | | 899 | 0,13 |
| Nationwide Building Society 2,972 % éch. 16/02/2028 | | 2 100 | 0,29 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | Ares European CLO DAC 4,843 % éch. 20/04/2032 | € | 300 | 0,05 |
| NatWest Group PLC 6,016 % éch. 02/03/2034 | | 1 900 | 0,30 | 3,000 % éch. 01/01/2054 | | 10 200 | 1,35 | Argent Securities Trust 5,770 % éch. 25/07/2036 | \$ | 1 072 | 0,14 |
| Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034 | | 1 900 | 0,30 | 3,500 % éch. 01/01/2054 | | 15 700 | 2,15 | 5,790 % éch. 25/05/2036 | | 391 | 0,01 |
| Sunac China Holdings Ltd. 6,000 % éch. 30/09/2026 | | 30 | 0,00 | 4,000 % éch. 01/01/2054 | | 12 100 | 1,71 | Asset-Backed Funding Certificates Trust 5,610 % éch. 25/10/2036 | | 131 | 0,02 |
| 6,250 % éch. 30/09/2027 | | 30 | 0,00 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | | 11 000 | 1,59 | 6,170 % éch. 25/06/2034 | | 541 | 0,08 |
| 6,500 % éch. 30/09/2027 | | 60 | 0,00 | 5,000 % éch. 01/01/2054 | | 24 100 | 3,56 | 6,205 % éch. 25/03/2035 | | 626 | 0,09 |
| 6,750 % éch. 30/09/2028 | | 91 | 0,00 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | | 28 700 | 4,30 | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 4,120 % éch. 25/12/2036 | | 596 | 0,09 |
| 7,000 % éch. 30/09/2029 | | 91 | 0,00 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | | 23 700 | 3,59 | Cairn CLO DAC 4,666 % éch. 25/04/2032 | € | 199 | 0,03 |
| 7,250 % éch. 30/09/2030 | | 43 | 0,00 | 7,000 % éch. 01/03/2054 | | 2 100 | 0,32 | Catamaran CLO Ltd. 6,774 % éch. 22/04/2030 | \$ | 878 | 0,13 |
| UBS Group AG 6,537 % éch. 12/08/2033 | | 3 100 | 0,49 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | Centex Home Equity Loan Trust 6,520 % éch. 25/10/2035 | | 993 | 0,14 |
| UniCredit SpA 5,459 % éch. 30/06/2035 | | 1 400 | 0,20 | Obligations du Trésor américain 1,375 % éch. 15/11/2040 | | 5 700 | 0,56 | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,905 % éch. 25/11/2036 | | 135 | 0,02 |
| VICI Properties LP 3,875 % éch. 15/02/2029 | | 800 | 0,11 | 4,000 % éch. 15/11/2042 | | 3 040 | 0,44 | 6,370 % éch. 25/01/2036 | | 985 | 0,14 |
| 4,625 % éch. 01/12/2029 | | 800 | 0,11 | 4,000 % éch. 15/11/2052 | | 2 290 | 0,34 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,348 % éch. 25/12/2034 | | 1 261 | 0,18 |
| Yango Justice International Ltd. 7,500 % éch. 15/04/2024 ^ | | 1 300 | 0,00 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (g) | | | | 5,730 % éch. 25/12/2036 | | 196 | 0,03 |
| | | 23 258 | 3,47 | 1,125 % éch. 15/01/2033 | | 14 977 | 2,12 | 5,930 % éch. 25/05/2037 | | 8 941 | 1,22 |
| | | | | Billets du Trésor américain | | | | 7,420 % éch. 25/08/2035 | | 750 | 0,10 |
| | | | | 4,375 % éch. 30/11/2030 | | 22 500 | 3,45 | Ellington Loan Acquisition Trust 6,570 % éch. 25/05/2037 | | 202 | 0,03 |
| | | | | | | 46 320 | 6,91 | First Franklin Mortgage Loan Trust 5,590 % éch. 25/11/2036 | | 550 | 0,08 |
| | | | | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | 6,070 % éch. 25/07/2035 | | 1 339 | 0,20 |
| | | | | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 4,213 % éch. 25/07/2036 | | 93 | 0,01 | 6,175 % éch. 25/11/2036 | | 1 785 | 0,25 |
| | | | | 4,635 % éch. 25/02/2036 | | 36 | 0,01 | 6,415 % éch. 25/06/2034 | | 740 | 0,11 |
| | | | | Bear Stearns Mortgage Funding Trust 5,770 % éch. 25/04/2037 | | 1 355 | 0,18 | Fremont Home Loan Trust 5,620 % éch. 25/10/2036 | | 6 452 | 0,39 |
| | | | | Countrywide Alternative Loan Trust 5,770 % éch. 25/07/2035 | | 873 | 0,10 | GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,893 % éch. 20/01/2032 | € | 300 | 0,05 |
| | | | | 5,790 % éch. 25/09/2047 | | 180 | 0,02 | GSAMP Trust 6,145 % éch. 25/11/2035 | \$ | 350 | 0,05 |
| | | | | 6,000 % éch. 25/04/2037 | | 715 | 0,09 | Harvest CLO DAC 4,815 % éch. 15/01/2032 | € | 800 | 0,13 |
| | | | | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 6,090 % éch. 25/04/2035 | | 108 | 0,01 | Home Equity Asset Trust 6,145 % éch. 25/02/2036 | \$ | 2 643 | 0,38 |
| | | | | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 6,000 % éch. 25/02/2037 | | 44 | 0,00 | Invesco Euro CLO DAC 4,615 % éch. 15/07/2031 | € | 500 | 0,08 |
| | | | | HomeBanc Mortgage Trust 6,330 % éch. 25/08/2029 | | 263 | 0,04 | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,414 % éch. 25/03/2047 | \$ | 1 185 | 0,11 |
| | | | | Impac CMB Trust 6,090 % éch. 25/04/2035 | | 161 | 0,02 | 5,680 % éch. 25/10/2036 | | 36 | 0,01 |
| | | | | 6,115 % éch. 25/04/2035 | | 206 | 0,03 | 5,770 % éch. 25/03/2037 | | 1 000 | 0,14 |
| | | | | IndyMac Mortgage Loan Trust 5,630 % éch. 25/04/2037 | | 1 769 | 0,24 | Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 7,170 % éch. 15/04/2040 | | 784 | 0,10 |
| | | | | 6,030 % éch. 25/07/2035 | | 90 | 0,01 | Long Beach Mortgage Loan Trust 6,070 % éch. 25/01/2036 | | 2 188 | 0,28 |
| | | | | Lehman XS Trust 5,870 % éch. 25/08/2046 | | 1 057 | 0,14 | 6,745 % éch. 25/02/2035 | | 466 | 0,07 |
| | | | | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 5,950 % éch. 25/05/2037 | | 567 | 0,04 | Man GLG Euro CLO DAC 4,835 % éch. 15/01/2030 | € | 105 | 0,02 |
| | | | | Residential Accredit Loans, Inc. Trust 5,990 % éch. 25/06/2046 | | 1 259 | 0,05 | MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,680 % éch. 25/05/2037 | \$ | 641 | 0,09 |
| | | | | 6,000 % éch. 25/12/2036 | | 299 | 0,04 | | | | |
| | | | | Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,770 % éch. 25/02/2037 | | 352 | 0,05 | | | | |
| | | | | Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | £ | 969 | 0,18 | | | | |
| | | | | Tower Bridge Funding PLC 0,000 % éch. 20/01/2066 (b) | | 1 000 | 0,19 | | | | |
| | | | | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 6,130 % éch. 25/01/2045 | \$ | 1 916 | 0,27 | | | | |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|--|-----------|----------------------------|---------------------|---|---------|----------------------------|---------------------|
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 6,400 % éch. 25/07/2035 | \$ 615 | \$ 610 | 0,09 | Focus Media Information Technology Co. Ltd. « A » Hellenic | 49 700 | \$ 44 | 0,01 | Tofas Turk Otomobil Fabrikasi A/S | 7 175 | \$ 51 | 0,01 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,580 % éch. 25/03/2037 | 1 333 | 571 | 0,08 | Telecommunications Organization S.A. | 11 007 | 157 | 0,02 | Tongcheng Travel Holdings Ltd. (d) | 71 200 | 132 | 0,02 |
| 5,600 % éch. 25/10/2036 | 81 | 70 | 0,01 | Konami Group Corp. (d) | 5 800 | 303 | 0,04 | Topsports International Holdings Ltd. | 107 000 | 83 | 0,01 |
| 5,610 % éch. 25/10/2036 | 1 048 | 453 | 0,07 | Koninklijke KPN NV | 159 128 | 549 | 0,08 | Vipshop Holdings Ltd. (d) | 19 498 | 346 | 0,05 |
| 5,770 % éch. 25/06/2036 | 244 | 202 | 0,03 | Meta Platforms, Inc. « A » (d) | 24 921 | 8 821 | 1,32 | Woolworths Holdings Ltd. | 53 891 | 213 | 0,03 |
| 6,720 % éch. 25/07/2037 | 800 | 674 | 0,10 | Nintendo Co. Ltd. (d) | 59 600 | 3 102 | 0,46 | Yadea Group Holdings Ltd. | 70 000 | 123 | 0,02 |
| Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,717 % éch. 20/04/2031 | 250 | 250 | 0,04 | PLDT, Inc. | 3 380 | 78 | 0,01 | | | 48 302 | 7,21 |
| OCP Euro CLO DAC 4,785 % éch. 15/01/2032 | € 826 | 908 | 0,13 | Telkom Indonesia Persero Tbk PT | 2 845 800 | 730 | 0,11 | BIENS DE CONSOMMATION COURANTE | | | |
| 4,882 % éch. 22/09/2034 | 1 100 | 1 198 | 0,18 | Tencent Holdings Ltd. | 99 300 | 3 749 | 0,56 | Altria Group, Inc. | 102 463 | 4 133 | 0,62 |
| Option One Mortgage Loan Trust 6,205 % éch. 25/05/2035 | \$ 468 | 443 | 0,07 | Verizon Communications, Inc. (d) | 72 809 | 2 745 | 0,41 | Ambev S.A. | 271 400 | 763 | 0,11 |
| 6,340 % éch. 25/05/2035 | 1 151 | 963 | 0,14 | | | 36 523 | 5,45 | China Feihe Ltd. | 208 000 | 114 | 0,02 |
| OZLM Ltd. 6,827 % éch. 20/01/2031 | 241 | 241 | 0,04 | BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE | | | | Coca-Cola Co. | 54 629 | 3 219 | 0,48 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 1 912 | 2 078 | 0,31 | Aisin Corp. (d) | 8 500 | 296 | 0,04 | Coca-Cola Femsa S.A.B. de C.V. | 30 500 | 290 | 0,04 |
| 4,745 % éch. 15/04/2031 | 588 | 640 | 0,09 | Alibaba Group Holding Ltd. | 449 100 | 4 326 | 0,65 | Coles Group Ltd. | 17 438 | 192 | 0,03 |
| Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 5,965 % éch. 25/07/2036 | \$ 254 | 237 | 0,03 | Amazon.com, Inc. (d) | 40 897 | 6 214 | 0,93 | Colgate-Palmolive Co. | 24 288 | 1 936 | 0,29 |
| Residential Asset Mortgage Products Trust 5,820 % éch. 25/10/2036 | 497 | 473 | 0,07 | Americana Restaurants International PLC | 145 048 | 124 | 0,02 | Empire Co. Ltd. « A » (d) | 8 337 | 221 | 0,03 |
| Residential Asset Securities Corp. Trust 5,720 % éch. 25/11/2036 | 2 896 | 2 537 | 0,38 | Bayerische Motoren Werke AG | 1 538 | 171 | 0,03 | George Weston Ltd. | 3 585 | 447 | 0,07 |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,820 % éch. 25/05/2037 | 122 | 88 | 0,01 | Booking Holdings, Inc. (d) | 2 075 | 7 361 | 1,10 | Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd. « A » | 11 900 | 45 | 0,01 |
| 6,250 % éch. 25/02/2034 | 267 | 263 | 0,04 | Bosideng International Holdings Ltd. | 220 000 | 99 | 0,01 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd. « A » | 21 900 | 83 | 0,01 |
| Segovia European CLO DAC 4,873 % éch. 20/07/2032 | € 700 | 763 | 0,11 | Bridgestone Corp. | 32 800 | 1 355 | 0,20 | Jeronimo Martins SGPS S.A. | 16 250 | 414 | 0,06 |
| Sound Point CLO Ltd. 6,807 % éch. 18/04/2031 | \$ 800 | 799 | 0,12 | BYD Co. Ltd. « A » | 6 200 | 173 | 0,03 | Kimberly-Clark Corp. | 19 366 | 2 353 | 0,35 |
| Structured Asset Investment Loan Trust 6,090 % éch. 25/01/2036 | 416 | 383 | 0,06 | Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd. | 112 000 | 164 | 0,02 | Kuala Lumpur Kepong Bhd. (d) | 27 900 | 132 | 0,02 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 6,040 % éch. 25/10/2036 | 171 | 166 | 0,02 | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd. | 114 800 | 171 | 0,03 | Loblaws Cos. Ltd. | 8 755 | 852 | 0,13 |
| 6,265 % éch. 25/02/2036 | 200 | 192 | 0,03 | Cie Générale des Établissements Michelin S.C.A. | 8 896 | 320 | 0,05 | MEIJI Holdings Co. Ltd. (d) | 13 500 | 321 | 0,05 |
| 6,475 % éch. 25/11/2035 | 1 000 | 985 | 0,15 | D.R. Horton, Inc. | 17 620 | 2 678 | 0,40 | PepsiCo, Inc. | 5 715 | 971 | 0,15 |
| Toro European CLO DAC 4,908 % éch. 12/01/2032 | € 300 | 329 | 0,05 | eBay, Inc. | 30 694 | 1 339 | 0,20 | President Chain Store Corp. | 33 000 | 290 | 0,04 |
| Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust 5,780 % éch. 25/08/2036 | \$ 473 | 447 | 0,07 | Expedia Group, Inc. (d) | 7 927 | 1 203 | 0,18 | Procter & Gamble Co. | 9 188 | 1 346 | 0,20 |
| | | 52 885 | 7,89 | Ford Otomotiv Sanayi A/S | 4 028 | 101 | 0,01 | Tesco PLC | 294 986 | 1 093 | 0,16 |
| | | | | Fuyao Glass Industry Group Co. Ltd. « H » | 34 800 | 170 | 0,03 | Want Want China Holdings Ltd. | 237 000 | 143 | 0,02 |
| | | | | Garmin Ltd. (d) | 8 784 | 1 129 | 0,17 | Wuliangye Yibin Co. Ltd. « A » | 13 400 | 265 | 0,04 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | General Motors Co. | 45 290 | 1 627 | 0,24 | | | 19 623 | 2,93 |
| Obligation internationale du gouvernement argentin 0,750 % éch. 09/07/2030 | 994 | 382 | 0,06 | Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai « A » | 9 700 | 44 | 0,01 | ÉNERGIE | | | |
| 3,625 % éch. 09/07/2035 | 653 | 216 | 0,03 | Hankook Tire & Technology Co. Ltd. (d) | 4 275 | 150 | 0,02 | APA Corp. (d) | 13 692 | 491 | 0,07 |
| TES colombien 5,750 % éch. 03/11/2027 | COP 16 619 000 | 3 798 | 0,57 | Honda Motor Co. Ltd. (d) | 60 100 | 620 | 0,09 | China Shenhua Energy Co. Ltd. « A » | 22 700 | 100 | 0,02 |
| 7,750 % éch. 18/09/2030 | 25 722 500 | 6 052 | 0,90 | Industria de Diseno Textil S.A. | 24 013 | 1 048 | 0,16 | China Shenhua Energy Co. Ltd. 'H' | 194 000 | 665 | 0,10 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 1,700 % éch. 20/09/2044 | ¥ 600 000 | 4 461 | 0,67 | InterContinental Hotels Group PLC | 5 590 | 504 | 0,07 | Exxaro Resources Ltd. | 14 194 | 159 | 0,02 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 (g) MXN | 24 926 | 1 300 | 0,19 | Kia Corp. (d) | 15 029 | 1 162 | 0,17 | HF Sinclair Corp. | 8 831 | 491 | 0,07 |
| 4,000 % éch. 30/11/2028 (g) | 1 386 | 80 | 0,01 | La Française des Jeux SAEM | 4 281 | 156 | 0,02 | Marathon Petroleum Corp. | 23 245 | 3 449 | 0,51 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 1,862 % éch. 01/12/2032 | \$ 1 800 | 1 414 | 0,21 | Lennar Corp. « A » | 14 495 | 2 160 | 0,32 | MOL Hungarian Oil & Gas PLC | 26 130 | 213 | 0,03 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 96 750 | 5 538 | 0,83 | LPP S.A. | 64 | 264 | 0,04 | Motor Oil Hellas Corinth Refineries S.A. | 3 814 | 100 | 0,02 |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,700 % éch. 30/04/2032 | € 5 000 | 4 661 | 0,69 | Mazda Motor Corp. (d) | 32 600 | 349 | 0,05 | Parkland Corp. (j) | 3 819 | 124 | 0,02 |
| | | 27 902 | 4,16 | Next PLC | 6 913 | 715 | 0,11 | Petroleo Brasileiro S.A. | 213 700 | 1 707 | 0,25 |
| | | | | NVR, Inc. (d) | 186 | 1 302 | 0,19 | Petronas Dagangan Bhd. | 17 100 | 81 | 0,01 |
| ACTIONS | | | | O'Reilly Automotive, Inc. (d) | 579 | 550 | 0,08 | Phillips 66 | 14 533 | 1 935 | 0,29 |
| SERVICES DE COMMUNICATION | | | | OPAP S.A. | 10 618 | 180 | 0,03 | Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A. | 33 356 | 556 | 0,08 |
| Alphabet, Inc. « A » (d) | 47 920 | 6 694 | 1,00 | PulteGroup, Inc. | 12 423 | 1 282 | 0,19 | Shell PLC (d) | 23 563 | 771 | 0,12 |
| Alphabet, Inc. « C » (d) | 52 594 | 7 412 | 1,11 | Ross Stores, Inc. | 16 390 | 2 268 | 0,34 | Tenaris S.A. | 27 097 | 472 | 0,07 |
| Autohome, Inc. | 3 890 | 109 | 0,02 | Sekisui Chemical Co. Ltd. (d) | 22 100 | 318 | 0,05 | United Tractors Tbk PT | 85 700 | 126 | 0,02 |
| Electronic Arts, Inc. | 14 839 | 2 030 | 0,30 | Stellantis NV | 55 543 | 1 302 | 0,19 | Valero Energy Corp. | 20 445 | 2 658 | 0,40 |
| | | | | Subaru Corp. (d) | 35 300 | 644 | 0,10 | | | 14 098 | 2,10 |
| | | | | Sumitomo Electric Industries Ltd. (d) | 41 000 | 520 | 0,08 | SERVICES FINANCIERS | | | |
| | | | | TJX Cos., Inc. (d) | 29 791 | 2 795 | 0,42 | 3i Group PLC | 55 854 | 1 719 | 0,26 |
| | | | | | | | | Aflac, Inc. (d) | 32 494 | 2 681 | 0,40 |
| | | | | | | | | Akbank T.A.S. | 179 085 | 221 | 0,03 |
| | | | | | | | | American Financial Group, Inc. | 966 | 115 | 0,02 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-----------|----------------------------------|------------------------------|---|-----------|----------------------------------|------------------------------|---|---------|----------------------------------|------------------------------|
| Ameriprise Financial, Inc. | 1 320 | \$ 501 | 0,07 | Singapore Exchange Ltd. | 49 200 | \$ 366 | 0,05 | Fortune Brands Innovations, Inc. (d) | 7 273 | \$ 554 | 0,08 |
| Amundi S.A. | 3 510 | 240 | 0,04 | Sompo Holdings, Inc. (d) | 17 000 | 832 | 0,12 | GEA Group AG | 8 804 | 366 | 0,05 |
| Arch Capital Group Ltd. (d) | 7 866 | 584 | 0,09 | Swiss Re AG | 17 510 | 1 969 | 0,29 | General Dynamics Corp. (d) | 5 999 | 1 558 | 0,23 |
| Assicurazioni Generali SpA | 58 160 | 1 230 | 0,18 | Türkiye İş Bankası A.S. « C » | 200 896 | 158 | 0,02 | GS Holdings Corp. | 2 683 | 85 | 0,01 |
| AXA S.A. | 90 822 | 2 968 | 0,44 | Visa, Inc. « A » | 8 417 | 2 191 | 0,33 | Hanwha Aerospace Co. Ltd. (d) | 2 038 | 197 | 0,03 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | 342 321 | 3 122 | 0,47 | W.R. Berkley Corp. | 11 975 | 847 | 0,13 | Hitachi Ltd. (d) | 24 900 | 1 791 | 0,27 |
| Banco de Chile | 2 642 680 | 313 | 0,05 | Washington H Soul Pattinson & Co. Ltd. | 13 620 | 305 | 0,05 | HMM Co. Ltd. (d) | 14 062 | 213 | 0,03 |
| Banco do Brasil S.A. | 49 400 | 563 | 0,08 | Wells Fargo & Co. | 2 356 | 116 | 0,02 | Horizon Construction Development Ltd. (d) | 2 741 | 2 | 0,00 |
| Banco Santander S.A. | 782 775 | 3 276 | 0,49 | Yapi ve Kredi Bankası A/S | 193 941 | 128 | 0,02 | Huntington Ingalls Industries, Inc. | 2 290 | 595 | 0,09 |
| Bank of the Philippine Islands | 114 340 | 214 | 0,03 | Zurich Insurance Group AG | 1 156 | 604 | 0,09 | Hyundai Glovis Co. Ltd. (d) | 1 078 | 160 | 0,02 |
| BB Seguridade Participações S.A. | 40 200 | 279 | 0,04 | | | 52 541 | 7,84 | Industries Qatar QSC | 87 941 | 311 | 0,05 |
| Berkshire Hathaway, Inc. « B » (d) | 175 | 62 | 0,01 | SOINS DE SANTÉ | | | | International Container Terminal Services, Inc. | 32 730 | 146 | 0,02 |
| Brookfield Asset Management Ltd. « A » | 1 462 | 59 | 0,01 | AbbVie, Inc. (d) | 48 112 | 7 456 | 1,11 | ITOCHU Corp. (d) | 46 600 | 1 899 | 0,28 |
| CaixaBank S.A. | 236 775 | 976 | 0,15 | AstraZeneca PLC | 1 690 | 228 | 0,04 | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd. (d) | 7 900 | 338 | 0,05 |
| Choe Global Markets, Inc. | 6 060 | 1 082 | 0,16 | Bristol-Myers Squibb Co. (d) | 112 820 | 5 789 | 0,87 | KOC Holding A/S | 43 668 | 209 | 0,03 |
| China Construction Bank Corp. « H » | 1 715 000 | 1 020 | 0,15 | Centene Corp. (d) | 30 991 | 2 300 | 0,34 | Korean Air Lines Co. Ltd. (d) | 10 588 | 196 | 0,03 |
| China Pacific Insurance Group Co. Ltd. « A » | 175 000 | 385 | 0,06 | Cigna Group | 5 904 | 1 768 | 0,26 | Kuehne + Nagel International AG | 3 118 | 1 075 | 0,16 |
| Chubb Ltd. | 9 679 | 2 188 | 0,33 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd. | 512 000 | 476 | 0,07 | Makita Corp. | 7 700 | 212 | 0,03 |
| Cincinnati Financial Corp. | 9 024 | 934 | 0,14 | Gilead Sciences, Inc. | 70 103 | 5 679 | 0,85 | Marubeni Corp. (d) | 82 800 | 1 304 | 0,19 |
| CME Group, Inc. | 5 151 | 1 085 | 0,16 | GSK PLC (d) | 57 364 | 1 060 | 0,16 | Masco Corp. | 12 920 | 865 | 0,13 |
| DB Insurance Co. Ltd. (d) | 2 647 | 171 | 0,03 | Humana, Inc. | 5 312 | 2 432 | 0,36 | MISC Bhd. | 55 800 | 88 | 0,01 |
| Erie Indemnity Co. « A » (d) | 1 458 | 488 | 0,07 | Ipsen S.A. | 2 164 | 258 | 0,04 | Mitsubishi Corp. (d) | 198 000 | 3 154 | 0,47 |
| Erste Group Bank AG | 19 731 | 800 | 0,12 | Johnson & Johnson | 46 328 | 7 261 | 1,08 | Mitsui & Co. Ltd. (d) | 74 200 | 2 780 | 0,42 |
| Eurazeo SE | 2 529 | 201 | 0,03 | Kyowa Kirin Co. Ltd. | 15 500 | 260 | 0,04 | Mitsui OSK Lines Ltd. (d) | 19 700 | 630 | 0,09 |
| Everest Group Ltd. | 2 461 | 870 | 0,13 | Merck & Co., Inc. | 52 378 | 5 710 | 0,85 | Mytilineos S.A. | 5 181 | 210 | 0,03 |
| EXOR NV | 5 432 | 544 | 0,08 | Novartis AG | 41 660 | 4 205 | 0,63 | Nippon Yusen KK (d) | 27 800 | 859 | 0,13 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. | 1 225 | 1 136 | 0,17 | Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (d) | 1 275 | 1 120 | 0,17 | Orient Overseas International Ltd. | 7 500 | 105 | 0,02 |
| Far East Horizon Ltd. | 74 000 | 58 | 0,01 | Richter Gedeon Nyrt | 7 285 | 184 | 0,03 | Owens Corning (d) | 5 172 | 767 | 0,11 |
| FirstRand Ltd. | 289 665 | 1 163 | 0,17 | Roche Holding AG | 11 597 | 3 369 | 0,50 | PACCAR, Inc. (d) | 700 | 68 | 0,01 |
| Globe Life, Inc. (d) | 1 671 | 203 | 0,03 | UnitedHealth Group, Inc. | 3 204 | 1 687 | 0,25 | ROCKWOOL A/S « B » | 528 | 155 | 0,02 |
| Haci Omer Sabanci Holding A/S | 58 559 | 120 | 0,02 | | | 51 242 | 7,65 | Siemens AG (d) | 2 281 | 428 | 0,06 |
| Hartford Financial Services Group, Inc. | 17 328 | 1 393 | 0,21 | INDUSTRIE | | | | Taisei Corp. (d) | 8 200 | 280 | 0,04 |
| Huatai Securities Co. Ltd. « A » | 25 300 | 50 | 0,01 | 3M Co. | 14 829 | 1 621 | 0,24 | Thales S.A. | 6 031 | 894 | 0,13 |
| Huatai Securities Co. Ltd. « H » | 75 000 | 95 | 0,01 | A.O. Smith Corp. | 7 149 | 589 | 0,09 | Toyota Tsusho Corp. (d) | 12 200 | 716 | 0,11 |
| IGM Financial, Inc. | 4 781 | 127 | 0,02 | AGC, Inc. | 11 200 | 415 | 0,06 | Türkiye Sise ve Cam Fabrikaları A/S | 79 122 | 123 | 0,02 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. « A » | 218 700 | 147 | 0,02 | Allegion PLC | 1 090 | 138 | 0,02 | Veralto Corp. | 13 413 | 1 103 | 0,16 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. « H » | 107 000 | 52 | 0,01 | AP Moller - Maersk A/S « A » | 174 | 309 | 0,05 | Vinci S.A. | 28 099 | 3 538 | 0,53 |
| Industrivarden AB « A » | 7 539 | 247 | 0,04 | AP Moller - Maersk A/S « B » | 278 | 501 | 0,08 | Weichai Power Co. Ltd. « A » | 23 400 | 45 | 0,01 |
| JPMorgan Chase & Co. (d) | 865 | 147 | 0,02 | Astra International Tbk PT | 1 163 000 | 427 | 0,06 | | 46 086 | 6,88 | |
| Julius Baer Group Ltd. | 11 819 | 663 | 0,10 | AviChina Industry & Technology Co. Ltd. « H » | 143 000 | 61 | 0,01 | TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION | | | |
| Mastercard, Inc. « A » (d) | 1 215 | 518 | 0,08 | BAE Systems PLC | 174 929 | 2 476 | 0,37 | Adobe, Inc. (d) | 530 | 316 | 0,05 |
| Metropolitan Bank & Trust Co. Muenchener Ruckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 71 160 | 66 | 0,01 | BOC Aviation Ltd. | 11 600 | 89 | 0,01 | Apple, Inc. | 82 221 | 15 831 | 2,36 |
| New China Life Insurance Co. Ltd. « H » | 47 500 | 93 | 0,01 | Brambles Ltd. | 34 535 | 321 | 0,05 | Applied Materials, Inc. (d) | 11 375 | 1 844 | 0,28 |
| ORIX Corp. (d) | 22 400 | 421 | 0,06 | Brenntag SE | 7 982 | 734 | 0,11 | ASE Technology Holding Co. Ltd. | 176 000 | 771 | 0,11 |
| OTP Bank Nyrt | 11 833 | 540 | 0,08 | Budimex S.A. | 734 | 117 | 0,02 | Asustek Computer, Inc. | 36 000 | 573 | 0,09 |
| PayPal Holdings, Inc. (d) | 60 614 | 3 722 | 0,56 | Builders FirstSource, Inc. (d) | 7 102 | 1 186 | 0,18 | Autodesk, Inc. (d) | 12 268 | 2 987 | 0,45 |
| People's Insurance Co. Group of China Ltd. « H » | 501 000 | 154 | 0,02 | Bunzl PLC | 12 485 | 507 | 0,08 | Broadcom, Inc. | 2 520 | 2 813 | 0,42 |
| PICC Property & Casualty Co. Ltd. « H » | 396 000 | 471 | 0,07 | Carlisle Cos., Inc. | 2 799 | 874 | 0,13 | Brother Industries Ltd. (d) | 13 300 | 212 | 0,03 |
| Poste Italiane SpA | 29 980 | 341 | 0,05 | Caterpillar, Inc. (d) | 7 698 | 2 276 | 0,34 | Canon, Inc. | 57 400 | 1 473 | 0,22 |
| Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A. | 34 735 | 418 | 0,06 | China Railway Group Ltd. « A » | 70 800 | 57 | 0,01 | Check Point Software Technologies Ltd. (d) | 5 372 | 821 | 0,12 |
| Qifu Technology, Inc. | 6 062 | 96 | 0,01 | Cie de Saint-Gobain S.A. | 25 979 | 1 917 | 0,29 | Cisco Systems, Inc. (d) | 171 256 | 8 652 | 1,29 |
| Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. (d) | 1 771 | 361 | 0,05 | COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. « A » | 44 100 | 60 | 0,01 | Compal Electronics, Inc. | 240 000 | 311 | 0,05 |
| SEI Investments Co. | 6 504 | 413 | 0,06 | COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. « H » | 173 500 | 174 | 0,03 | Dropbox, Inc. « A » (d) | 14 896 | 439 | 0,07 |
| | | | | CRRC Corp. Ltd. « A » | 83 800 | 62 | 0,01 | F5, Inc. (d) | 790 | 141 | 0,02 |
| | | | | CRRC Corp. Ltd. « H » | 251 000 | 111 | 0,02 | Fortinet, Inc. (d) | 35 222 | 2 062 | 0,31 |
| | | | | Cummins, Inc. | 318 | 76 | 0,01 | Foxconn Industrial Internet Co. Ltd. « A » | 34 200 | 73 | 0,01 |
| | | | | Daqin Railway Co. Ltd. « A » | 52 200 | 53 | 0,01 | GoDaddy, Inc. « A » (d) | 8 049 | 854 | 0,13 |
| | | | | Dassault Aviation S.A. | 993 | 197 | 0,03 | Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. | 227 000 | 772 | 0,12 |
| | | | | Eiffage S.A. | 4 218 | 453 | 0,07 | | | | |
| | | | | Ferguson PLC | 11 737 | 2 266 | 0,34 | | | | |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite)

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|---------|----------------------------|---------------------|---|-----------|----------------------------|---------------------|---|---------|----------------------------|---------------------|
| HP, Inc. | 30 263 | \$ 911 | 0,14 | Nucor Corp. | 14 420 | \$ 2 510 | 0,37 | SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER | | | |
| Intel Corp. | 23 150 | 1 163 | 0,17 | Packaging Corporation of America | 954 | 155 | 0,02 | Fibra Uno Administracion S.A. de C.V. | | | |
| Juniper Networks, Inc. | 18 460 | 544 | 0,08 | Reliance Steel & Aluminum Co. | 3 375 | 944 | 0,14 | 168 300 \$ 304 0,04 | | | |
| KLA Corp. | 5 384 | 3 130 | 0,47 | Steel Dynamics, Inc. | 8 886 | 1 050 | 0,16 | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | |
| Lam Research Corp. | 1 666 | 1 305 | 0,19 | Wanhua Chemical Group Co. Ltd. « A » | 10 800 | 117 | 0,02 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| Lite-On Technology Corp. | 116 000 | 440 | 0,07 | | | 9 814 | 1,46 | BONS DU TRÉSOR ARGENTIN | | | |
| Logitech International S.A. | 9 436 | 897 | 0,13 | IMMOBILIER | | | | (38,356) % éch. | | | |
| MediaTek, Inc. (d) | 87 000 | 2 873 | 0,43 | Aldar Properties PJSC | 221 134 | 322 | 0,05 | 20/05/2024 (e)(f) ARS 9 549 15 0,00 | | | |
| Microchip Technology, Inc. | 3 590 | 324 | 0,05 | Emaar Properties PJSC | 380 492 | 821 | 0,12 | 0,000 % éch. | | | |
| Microsoft Corp. (d) | 39 364 | 14 802 | 2,21 | | | 1 143 | 0,17 | 04/01/2024 (e)(f) HUF 387 000 1 118 0,17 | | | |
| NetApp, Inc. (d) | 11 774 | 1 038 | 0,15 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| Novatek | | | | Canadian Utilities Ltd. « A » | 7 525 | 182 | 0,03 | 5,371 % éch. | | | |
| Microelectronics Corp. | 33 000 | 555 | 0,08 | Centrica PLC | 299 277 | 537 | 0,08 | 11/01/2024 (e)(f) \$ 14 900 14 881 2,22 | | | |
| NXP Semiconductors NV | 14 909 | 3 424 | 0,51 | CEZ A/S | 9 364 | 402 | 0,06 | 5,371 % éch. | | | |
| Oracle Corp. Japan (d) | 2 200 | 169 | 0,03 | CGN Power Co. Ltd. « H » | 609 000 | 159 | 0,02 | 29/02/2024 (e)(f)(k) 3 600 3 569 0,53 | | | |
| Otsuka Corp. | 6 600 | 272 | 0,04 | CLP Holdings Ltd. | 95 500 | 789 | 0,12 | 5,371 % éch. | | | |
| Pegatron Corp. | 74 000 | 210 | 0,03 | CPFL Energia S.A. | 13 200 | 105 | 0,02 | 29/02/2024 (e)(f) 1 000 992 0,15 | | | |
| Qorvo, Inc. (d) | 5 661 | 637 | 0,09 | E.ON SE | 128 833 | 1 732 | 0,26 | 5,378 % éch. | | | |
| QUALCOMM, Inc. | 53 894 | 7 795 | 1,16 | Endesa S.A. | 18 227 | 372 | 0,05 | 29/02/2024 (e)(f) 700 694 0,10 | | | |
| Quanta Computer, Inc. | 10 000 | 73 | 0,01 | Enel Americas S.A. (d) | 1 230 210 | 137 | 0,02 | 5,382 % éch. | | | |
| Realtek Semiconductor Corp. | 28 000 | 429 | 0,06 | Enel SpA (d) | 472 072 | 3 515 | 0,52 | 11/01/2024 (e)(f) 6 000 5 992 0,90 | | | |
| Renesas Electronics Corp. (d) | 33 400 | 597 | 0,09 | Kansai Electric Power Co., Inc. (d) | 40 400 | 536 | 0,08 | 5,385 % éch. | | | |
| SAP SE | 21 262 | 3 275 | 0,49 | Kunlun Energy Co. Ltd. | 224 000 | 202 | 0,03 | 22/02/2024 (e)(f) 800 794 0,12 | | | |
| SCSK Corp. (d) | 5 200 | 103 | 0,02 | PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. (d) | 51 572 | 114 | 0,02 | 5,394 % éch. | | | |
| Shenzhen Transsion Holdings Co. Ltd. « A » | 2 769 | 54 | 0,01 | Sembcorp Industries Ltd. | 51 300 | 206 | 0,03 | 23/01/2024 (e)(f) 5 400 5 383 0,80 | | | |
| Skyworks Solutions, Inc. | 9 136 | 1 027 | 0,15 | Vistra Corp. | 16 753 | 645 | 0,10 | 5,394 % éch. | | | |
| STMicroelectronics NV (d) | 36 578 | 1 836 | 0,27 | | | 9 633 | 1,44 | 25/01/2024 (e)(f) 700 698 0,10 | | | |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. (d) | 322 000 | 6 173 | 0,92 | TITRES PRIVILÉGIÉS | | | | 5,427 % éch. | | | |
| Tokyo Electron Ltd. (d) | 1 800 | 320 | 0,05 | Bancolumbia S.A. 0,000 % | 26 335 | 203 | 0,03 | 26/03/2024 (e)(f) 5 700 5 631 0,84 | | | |
| Tongwei Co. Ltd. « A » | 15 500 | 55 | 0,01 | Cia Energetica de Minas Gerais 0,000 % | 79 900 | 190 | 0,03 | 38 634 5,76 | | | |
| Trend Micro, Inc. | 7 800 | 416 | 0,06 | Nationwide Building Society 10,250 % | 1 490 | 247 | 0,04 | 39 767 5,93 | | | |
| United Microelectronics Corp. | 645 000 | 1 099 | 0,16 | Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 % | 273 400 | 2 086 | 0,31 | Total des Instruments à court terme | | | |
| VeriSign, Inc. (d) | 4 625 | 953 | 0,14 | | | 2 726 | 0,41 | Total des Valeurs mobilières | | | |
| | | 97 844 | 14,60 | MATÉRIAUX | | | | \$ 767 569 114,54 | | | |
| Baoshan Iron & Steel Co. Ltd. « A » | 76 700 | 64 | 0,01 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | ACTIONS | | | |
| BlueScope Steel Ltd. | 9 857 | 157 | 0,02 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| CRH PLC | 18 420 | 1 268 | 0,19 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| Heidelberg Materials AG | 7 864 | 703 | 0,11 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Capital Securities Fund (i) | | | | 0 0 0,00 | | | |
| Holcim AG | 29 905 | 2 347 | 0,35 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i) | | | | 88 444 881 0,13 | | | |
| LyondellBasell Industries NV « A » | 5 250 | 499 | 0,07 | Total des Fonds d'investissement | | | | \$ 881 0,13 | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net | |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|-------------|
| DEU | 5,420 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 9 600 | Obligations du Trésor américain 3,750 % éch. 15/08/2041 | \$ (9 824) | \$ 9 600 | \$ 9 606 | 1,43 | |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 2 484 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | (2 534) | 2 484 | 2 485 | 0,37 | |
| SSB | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 520 | Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 31/10/2025 | (530) | 520 | 520 | 0,08 | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | \$ (12 888) | \$ 12 604 | \$ 12 611 | 1,88 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-valeur) latente | En % de l'actif net |
|---|-------|-------------------|------------------|------------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 10 | \$ 18 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index janvier | Court | 01/2024 | 10 | 6 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars | Long | 03/2024 | 1 | (1) | 0,00 |

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Indice Euro STOXX 50 Index mars | Court | 03/2024 | 19 | \$ 6 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index mars | Court | 03/2024 | 3 | (6) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE China A50 Index janvier | Long | 01/2024 | 82 | 23 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/JSE Index mars | Long | 03/2024 | 1 | 0 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice IBEX 35 Index janvier | Long | 01/2024 | 3 | (1) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Mini MSCI Emerging Markets Index mars | Court | 03/2024 | 7 | (17) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice MSCI Singapore Index janvier | Court | 01/2024 | 46 | (47) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index janvier | Long | 01/2024 | 12 | 0 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P CNX Nifty Index janvier | Long | 01/2024 | 7 | 3 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P/Toronto Stock Exchange 60 Index mars | Court | 03/2024 | 7 | (35) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index mars | Court | 03/2024 | 19 | (54) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Topix Index mars | Court | 03/2024 | 8 | (4) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 7 | (25) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 53 | (305) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 48 | 429 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 42 | (476) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice WIG20 Index mars | Court | 03/2024 | 8 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ (485) | (0,07) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (485) | (0,07) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | (5,000) % | 20/12/2028 | € 1 220 | \$ (39) | (0,01) |
| Indice iTraxx Europe Main 39 Index à 5 ans | (1,000) | 20/06/2028 | 1 980 | (10) | 0,00 |
| Indice iTraxx Europe Main 40 Index à 5 ans | (1,000) | 20/12/2028 | 3 000 | (15) | 0,00 |
| | | | | \$ (64) | (0,01) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/12/2028 | \$ 168 | \$ 2 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 350 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 2 | 0,00 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|------------------------|
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 % | 20/03/2034 | £ 1 100 | \$ 59 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050 | 15/12/2031 | ¥ 690 000 | (17) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,125 | 12/10/2024 | 18 020 000 | (18) | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,450 | 15/12/2051 | 300 000 | 6 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 21/03/2034 | 594 200 | (57) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,250 | 16/03/2024 | \$ 14 500 | 509 | 0,08 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2029 | 800 | (8) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 14 300 | (300) | (0,04) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2052 | 3 100 | (186) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2052 | 4 000 | 248 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,385 | 08/06/2032 | 6 100 | (150) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 7 400 | (605) | (0,09) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 5 100 | (175) | (0,03) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,085 | 13/02/2034 | 23 920 | (1 116) | (0,17) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 12 900 | (177) | (0,03) |
| À payer ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/03/2034 | 2 200 | 60 | 0,01 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,308 | 21/02/2029 | 21 700 | 561 | 0,08 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 02/04/2026 | 50 600 | 566 | 0,08 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 26 600 | (917) | (0,14) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 27 240 | (1 295) | (0,19) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 19 140 | 683 | 0,10 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 1 600 | 29 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 43 100 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 6 200 | 109 | 0,02 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2031 | 4 000 | (8) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2036 | 10 100 | 17 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,760 | 23/08/2033 | 7 135 | 303 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 4 504 | 52 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 1 817 | 53 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 % | 30/08/2033 | \$ 4 300 | \$ 185 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 475 | 50 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 52 120 | 511 | 0,08 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2031 | 13 800 | (301) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 1 700 | (83) | (0,01) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2034 | 7 600 | (205) | (0,03) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,604 | 04/01/2027 | BRL 27 900 | 84 | 0,01 |
| À payer ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 20/03/2034 | CAD 600 | 20 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | € 1 100 | 48 | 0,01 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,700 | 05/11/2027 | MXN 63 500 | 45 | 0,01 |
| | | | | | \$ (1 412) | (0,21) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (1 474) | (0,22) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽³⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽⁴⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description | Indice initial | Taux variable | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 100,151 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035 | 8 200 | \$ (253) | \$ (275) | (0,04) |
| JPM | Taux plafond - CPURNSA hors cote | 234,781 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0 | 16/05/2024 | 1 500 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ (253) | \$ (275) | (0,04) | |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/ (reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17/11/2059 | \$ 2 900 | \$ (9) | \$ 9 | \$ 0 | 0,00 |
| MYC | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 12 200 | (40) | 39 | (1) | 0,00 |
| SAL | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 2 200 | (22) | 13 | (9) | 0,00 |
| | | | | | \$ (71) | \$ 61 | \$ (10) | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/ à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/ (reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------|----------------------|----------------------------|---|-------------------|-----------------|-------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK | À recevoir | Indice NDUACWF Index | 35 000 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 13 584 | 05/06/2024 | \$ 0 | \$ (34) | \$ (34) | (0,01) |
| MEI | À recevoir | Indice BOVESPA Index | 23 | 0,000 % | BRL 2 984 | 14/02/2024 | 0 | 28 | 28 | 0,01 |
| MYI | À payer | Indice KOSPI2 Index | 3 500 000 | 0,000 | KRW 1 179 290 | 14/03/2024 | 0 | (70) | (70) | (0,01) |
| | À payer | Indice SET 50 Index | 16 200 | 0,000 | THB 14 050 | 28/03/2024 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | À recevoir | Indice NDUACWF Index | 1 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 41 539 | 27/11/2024 | 0 | (188) | (188) | (0,03) |
| | | | | | \$ 0 | \$ (267) | \$ (267) | (0,04) | | |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|--------|
| AZD | 01/2024 | AUD | \$ 14 630 | \$ 9 678 | \$ 0 | \$ (307) | (0,05) | | |
| | 01/2024 | \$ | 4 285 | AUD 6 471 | 131 | 0 | 0,02 | | |
| | 01/2024 | | 6 260 | ¥ 914 500 | 231 | 0 | 0,04 | | |
| | 01/2024 | | 459 | NZD 746 | 13 | 0 | 0,00 | | |
| | 03/2024 | CNH | 25 240 | \$ 3 502 | 0 | (63) | (0,01) | | |
| | 03/2024 | \$ | 634 | NZD 1 000 | 0 | (1) | 0,00 | | |
| BOA | 01/2024 | COP | 33 623 954 | \$ 8 370 | 3 | (302) | (0,04) | | |
| | 01/2024 | PLN | 3 200 | 814 | 0 | 0 | 0,00 | | |
| | 01/2024 | \$ | 8 780 | COP 33 623 954 | 7 | (118) | (0,02) | | |
| | 01/2024 | | 9 488 | ¥ 1 400 143 | 451 | 0 | 0,07 | | |
| | 02/2024 | CNY | 2 319 | \$ 321 | 0 | (7) | 0,00 | | |
| | 02/2024 | \$ | 888 | CNY 6 274 | 1 | 0 | 0,00 | | |
| | 03/2024 | CNH | 35 524 | \$ 4 905 | 0 | (113) | (0,02) | | |
| | 03/2024 | COP | 32 820 935 | 8 457 | 114 | 0 | 0,02 | | |
| | 03/2024 | INR | 82 329 | 984 | 0 | (3) | 0,00 | | |
| | 03/2024 | \$ | 207 | COP 803 020 | 0 | (3) | 0,00 | | |
| | 03/2024 | | 100 | IDR 1 539 470 | 0 | 0 | 0,00 | | |
| | 03/2024 | | 106 | INR 8 885 | 0 | 0 | 0,00 | | |
| | 03/2024 | | 200 | KRW 257 654 | 1 | 0 | 0,00 | | |
| | 03/2024 | | 100 | MXN 1 718 | 0 | 0 | 0,00 | | |
| | BPS | 01/2024 | AUD | 86 | \$ 57 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | | 01/2024 | BRL | 40 598 | 8 322 | 0 | (36) | (0,01) | |
| 01/2024 | | € | 3 887 | 4 254 | 0 | (41) | (0,01) | | |
| 01/2024 | | HUF | 44 927 | 128 | 0 | (2) | 0,00 | | |
| 01/2024 | | ¥ | 34 200 | 237 | 0 | (6) | 0,00 | | |
| 01/2024 | | NZD | 1 323 | 814 | 0 | (24) | 0,00 | | |
| 01/2024 | | \$ | 3 709 | AUD 5 505 | 48 | 0 | 48 | 0,01 | |
| 01/2024 | | | 22 | CAD 30 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 946 | € 865 | 9 | 0 | 9 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 1 627 | £ 1 288 | 15 | 0 | 15 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 238 | HUF 82 910 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 4 222 | ¥ 608 900 | 100 | 0 | 100 | 0,02 | |
| 01/2024 | | | 4 810 | ZAR 89 087 | 53 | 0 | 53 | 0,01 | |
| 01/2024 | | ZAR | 12 778 | \$ 689 | 0 | (8) | (8) | 0,00 | |
| 02/2024 | | \$ | 8 322 | BRL 40 771 | 58 | 0 | 58 | 0,01 | |
| 02/2024 | | | 1 576 | CNY 11 189 | 8 | 0 | 8 | 0,00 | |
| 02/2024 | | | 314 | TWD 9 990 | 13 | 0 | 13 | 0,00 | |
| 03/2024 | | CNH | 24 585 | \$ 3 416 | 0 | (56) | (56) | (0,01) | |
| 03/2024 | | INR | 285 968 | 3 419 | 0 | (8) | (8) | 0,00 | |
| 03/2024 | | NOK | 103 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | | TWD | 41 710 | 1 324 | 0 | (48) | (48) | (0,01) | |
| 03/2024 | | \$ | 911 | CAD 1 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | | | 24 010 | CNH 170 117 | 18 | 0 | 18 | 0,00 | |
| 03/2024 | | | 369 | INR 30 862 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| 03/2024 | | | 270 | SEK 2 677 | 0 | (4) | (4) | 0,00 | |
| 06/2024 | | | 172 | KRW 224 972 | 4 | 0 | 4 | 0,00 | |
| BRC | | 01/2024 | BRL | 11 | \$ 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | | 01/2024 | CHF | 4 216 | 4 875 | 0 | (137) | (0,02) | |
| | | 01/2024 | DKK | 340 | 50 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | | 01/2024 | PLN | 1 225 | 280 | 0 | (31) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 588 | CAD 799 | 19 | 0 | 19 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 5 522 | CHF 4 798 | 182 | 0 | 182 | 0,02 | |
| | 01/2024 | | 410 | € 378 | 8 | 0 | 8 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 19 | £ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 429 | NOK 4 620 | 26 | 0 | 26 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 166 | PLN 661 | 2 | 0 | 2 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNY | 107 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | SGD | 52 | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 3 026 | CLP 2 636 590 | 0 | (18) | (18) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 200 | HUF 70 620 | 2 | 0 | 2 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 100 | ILS 362 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 | THB 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 132 | TRY 4 128 | 0 | (2) | (2) | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 1 621 | 52 085 | 0 | (23) | (23) | 0,00 | |
| | 06/2024 | | 178 | KRW 231 887 | 4 | 0 | 4 | 0,00 | |
| | CBK | 01/2024 | AUD | 152 | \$ 103 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | 01/2024 | CAD | 5 475 | 4 092 | 0 | (61) | (61) | (0,01) |
| | | 01/2024 | £ | 2 892 | 3 675 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | | 01/2024 | HUF | 2 065 993 | 5 721 | 7 | (247) | (240) | (0,04) |
| 01/2024 | | MXN | 19 693 | 1 072 | 0 | (86) | (86) | (0,01) | |
| 01/2024 | | PLN | 5 954 | 1 357 | 0 | (157) | (157) | (0,02) | |
| 01/2024 | | SEK | 30 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 01/2024 | | \$ | 451 | CAD 604 | 7 | 0 | 7 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 784 | £ 617 | 3 | 0 | 3 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 29 | ¥ 4 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 118 | MXN 2 109 | 6 | 0 | 6 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 130 | NOK 1 400 | 7 | 0 | 7 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 3 | PLN 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 101 | SEK 1 055 | 4 | 0 | 4 | 0,00 | |
| 01/2024 | | ZAR | 7 744 | \$ 412 | 0 | (12) | (12) | 0,00 | |
| 02/2024 | | \$ | 192 | CNY 1 388 | 5 | 0 | 5 | 0,00 | |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | BRL | 2 610 | \$ 531 | \$ 0 | \$ (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | CAD | 300 | 225 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 211 | 56 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | PLN | 1 888 | 475 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 168 | BRL 831 | 2 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 537 | IDR 8 359 975 | 5 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 451 | ILS 1 641 | 6 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 100 | PEN 377 | 1 | 0 | 0,00 |
| DUB | 06/2024 | KRW | 322 966 | \$ 251 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK | 38 810 | 3 625 | 0 | (197) | (0,03) |
| | 01/2024 | PLN | 1 183 | 300 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 252 | PLN 1 000 | 2 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | BRL | 832 | \$ 168 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 16 907 | 2 346 | 0 | (42) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 100 | BRL 487 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 760 | SGD 1 005 | 5 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 100 984 | \$ 78 | 0 | (2) | 0,00 |
| FAR | 06/2024 | \$ | 193 | KRW 250 690 | 4 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 55 | \$ 41 | 0 | (1) | 0,00 |
| GLM | 03/2024 | \$ | 100 | THB 3 409 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 14 741 | \$ 840 | 0 | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD | 1 186 | 739 | 0 | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 167 | BRL 821 | 2 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 11 920 | CAD 16 198 | 366 | 0 | 0,06 |
| | 01/2024 | | 1 | MXN 17 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 132 | NOK 42 795 | 82 | 0 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 249 | NZD 400 | 4 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 384 | \$ 21 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 10 993 | 1 524 | 0 | (29) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 25 651 298 | 1 628 | 0 | (36) | (0,01) |
| | 03/2024 | PHP | 220 | 4 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 892 | AUD 1 300 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 600 | THB 20 758 | 12 | 0 | 0,00 |
| JPM | 03/2024 | | 16 | TRY 515 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 468 820 | \$ 1 295 | 0 | (58) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 4 917 | BRL 24 775 | 183 | 0 | 0,03 |
| | 01/2024 | | 622 | MXN 10 698 | 6 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | 3 940 | \$ 542 | 0 | (16) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 7 493 | INR 625 952 | 15 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 800 | TRY 24 409 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNY | 13 627 | \$ 1 920 | 0 | (16) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 128 916 | 8 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR | 85 713 | 1 025 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 111 | INR 9 250 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 200 | PLN 791 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 485 | TWD 15 080 | 11 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 260 464 | \$ 199 | 0 | (5) | 0,00 |
| MBC | 06/2024 | \$ | 173 | KRW 223 934 | 3 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 3 019 | \$ 3 267 | 0 | (69) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF | 72 257 | 205 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 9 100 | 64 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 758 | AUD 2 651 | 52 | 0 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 47 083 | € 42 823 | 232 | 0 | 0,03 |
| | 01/2024 | | 4 117 | £ 3 246 | 21 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 220 | HUF 1 181 199 | 184 | 0 | 0,03 |
| | 01/2024 | | 1 802 | ZAR 34 446 | 79 | 0 | 0,01 |
| | 03/2024 | IDR | 157 101 | \$ 10 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | NZD | 200 | 125 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | PHP | 1 177 | 21 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 03/2024 | \$ | 674 | PHP 37 737 | 7 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 9 816 | \$ 7 222 | 0 | (223) | (0,03) |
| | 01/2024 | € | 7 | 8 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 2 | 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 14 285 | 41 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR | 469 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN | 200 | 50 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 150 | € 136 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 28 | £ 22 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 608 | ¥ 531 866 | 167 | 0 | 0,03 |
| | 01/2024 | | 1 021 | MYR 4 765 | 17 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 515 | ZAR 9 467 | 2 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 84 901 | \$ 4 535 | 0 | (103) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ | 925 | CNY 6 552 | 3 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 24 085 | \$ 3 340 | 0 | (62) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 1 538 | BRL 7 662 | 30 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 3 614 | IDR 55 629 663 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 100 | MYR 459 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 336 | NOK 3 388 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 58 071 | \$ 45 | 0 | (1) | 0,00 |
| RBC | 06/2024 | \$ | 70 | KRW 90 573 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL | 1 310 | \$ 266 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 1 987 | 115 | 0 | (2) | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 01/2024 | \$ | 2 720 | MXN 46 681 | \$ 24 | \$ 0 | \$ 24 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 100 | CLP 88 690 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 480 | IDR 7 397 880 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 147 | INR 12 257 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | MXN | 21 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | € | 46 434 | 50 859 | 0 | (447) | (447) | (0,07) |
| | 01/2024 | \$ | 20 | £ 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 384 | 300 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 03/2024 | | 100 | PHP 5 553 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 37 | ¥ 5 300 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | AUD | 100 | \$ 68 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 23 646 | 3 266 | 0 | (74) | (74) | (0,01) |
| | 03/2024 | INR | 194 978 | 2 331 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | 44 939 | 317 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 22 643 | 717 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 110 | € 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 882 | HKD 6 879 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 194 | INR 16 226 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 06/2024 | | 92 | KRW 119 583 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | BRL | 1 633 | \$ 333 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 17 957 | 3 709 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | CLP | 2 637 825 | 2 984 | 0 | (34) | (34) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 3 613 | BRL 17 957 | 84 | 0 | 84 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 300 | CLP 265 248 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 31 496 821 | \$ 2 010 | 0 | (34) | (34) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 100 | COP 392 191 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 334 | € 300 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 300 | INR 25 046 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 368 | ¥ 51 715 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 200 | SGD 263 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | | 3 660 | ¥ 536 910 | 151 | 0 | 151 | 0,02 |
| | 03/2024 | CNH | 11 436 | \$ 1 584 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 100 | ZAR 1 850 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | CAD | 799 | \$ 591 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 3 497 | 3 806 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 2 816 | 3 564 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 1 360 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 11 478 400 | 77 980 | 0 | (3 613) | (3 613) | (0,54) |
| | 01/2024 | \$ | 1 032 | AUD 1 558 | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 103 | £ 81 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 003 | HUF 1 053 015 | 31 | 0 | 31 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 56 559 | ¥ 8 387 000 | 3 092 | 0 | 3 092 | 0,46 |
| | 01/2024 | | 627 | SEK 6 395 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 125 207 | \$ 6 559 | 0 | (278) | (278) | (0,04) |
| | 03/2024 | CZK | 80 572 | 3 619 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 352 | CHF 296 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | \$ 6 541 | \$ (7 538) | \$ (997) | (0,15) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 3 987 | \$ 2 640 | \$ 0 | \$ (81) | (0,01) | |
| BOA | 01/2024 | | 603 | 399 | 0 | (13) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 317 | 403 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | INR | 81 284 | 974 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 1 113 484 | 7 546 | 0 | (359) | (0,05) | |
| | 01/2024 | NZD | 402 | 245 | 0 | (10) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 203 | NOK 2 161 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | BRL | 6 | \$ 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | DKK | 6 228 | 919 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 9 110 | 9 962 | 0 | (103) | (103) | (0,02) |
| | 01/2024 | £ | 1 210 | 1 535 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | INR | 299 879 | 3 593 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 700 426 | 4 766 | 0 | (206) | (206) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ | 25 279 | € 23 168 | 321 | 0 | 321 | 0,05 |
| | 01/2024 | | 525 | ¥ 75 760 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 1 | BRL 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | THB | 30 392 | \$ 864 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 0 | CHF 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 114 911 | € 104 485 | 536 | 0 | 536 | 0,08 |
| CBK | 01/2024 | CHF | 216 | \$ 248 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 1 038 | 1 142 | 1 | (6) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 4 580 205 | 3 557 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK | 78 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 01/2024 | \$ | 1 231 | BRL 6 082 | \$ 21 | \$ 0 | \$ 21 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 0 | DKK 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 14 | € 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 869 | MXN 14 723 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 49 | NOK 523 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 170 | \$ 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL | 6 107 | 1 231 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| | 02/2024 | MXN | 14 723 | 865 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | SGD | 68 | 52 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| FAR | 01/2024 | BRL | 1 745 | 359 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 359 | BRL 1 753 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD | 10 853 | \$ 7 986 | 0 | (246) | (246) | (0,04) |
| | 01/2024 | CHF | 5 890 | 6 721 | 0 | (282) | (282) | (0,04) |
| | 01/2024 | CNY | 24 294 | 3 440 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | CZK | 10 186 | 460 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK | 8 250 | 1 217 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 147 527 | 421 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | ILS | 791 | 212 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR | 3 173 | 681 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN | 2 257 | 565 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 164 | CLP 144 422 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 683 | MYR 3 173 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 02/2024 | CLP | 144 422 | \$ 163 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 02/2024 | MYR | 3 173 | 684 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| IND | 01/2024 | \$ | 15 | CNY 104 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | BRL | 8 912 | \$ 1 829 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD | 8 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | AUD | 2 643 | 1 752 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| | 01/2024 | CLP | 144 422 | 165 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 6 376 | 6 968 | 0 | (77) | (77) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN | 14 723 | 856 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 163 | CAD 220 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | ¥ | 422 974 | \$ 2 869 | 0 | (133) | (133) | (0,02) |
| | 01/2024 | PHP | 30 830 | 556 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD | 1 069 | 802 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 154 486 | € 140 554 | 814 | 0 | 814 | 0,12 |
| SCX | 01/2024 | CNY | 194 | \$ 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HKD | 60 661 | 7 767 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK | 26 930 | 2 593 | 0 | (80) | (80) | (0,01) |
| | 01/2024 | TWD | 137 090 | 4 407 | 0 | (90) | (90) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 2 034 | CNY 14 493 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| SOG | 01/2024 | IDR | 14 349 923 | \$ 923 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 933 | BRL 4 581 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | | 3 | KRW 3 930 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ | 6 574 | \$ 8 320 | 0 | (61) | (61) | (0,01) |
| | 01/2024 | NOK | 3 686 | 346 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 154 605 | € 140 554 | 695 | 0 | 695 | 0,10 |
| | 01/2024 | ZAR | 10 717 | \$ 578 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | | | | | \$ 2 488 | \$ (1 995) | \$ 493 | 0,07 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| BOA | 01/2024 | AUD | 8 | \$ 5 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 1 275 | 9 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 41 | £ 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 0 | NZD 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | DKK | 8 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 2 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | INR | 468 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 1 042 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 34 | £ 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF | 1 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HKD | 6 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 47 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | THB | 42 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 0 | £ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ | 2 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 6 101 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | TWD | 25 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 | BRL 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 6 | £ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 | MXN 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL | 11 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | MXN | 16 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| FAR | 01/2024 | BRL | 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 0 | BRL 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | CAD | 12 | \$ 9 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | CHF | 7 | 7 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | CNY | 12 | 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | CZK | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ILS | 3 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | MYR | 3 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | PLN | 3 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 0 | CLP 120 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 1 | MYR 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | CLP | 120 | \$ 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | MYR | 3 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| JPM | 01/2024 | BRL | 11 | 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | CAD | 2 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | CLP | 120 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 8 | 10 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | MXN | 16 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 7 | £ 6 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | € | 24 | \$ 27 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 1 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 484 | 3 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | PHP | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | SGD | 1 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | CNY | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | HKD | 69 | 9 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | INR | 66 | 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | SEK | 29 | 3 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | TWD | 162 | 5 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 193 | £ 153 | 1 | 1 | 0,00 | |
| SOG | 01/2024 | IDR | 12 196 | \$ 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| SSB | 01/2024 | \$ | 105 | £ 84 | 1 | 1 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | 0 | KRW 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | CZK | 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | DKK | 11 | 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 195 | £ 154 | 1 | 1 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 27 | \$ 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | | | | | \$ 3 | \$ (1) | \$ 2 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en RMB (couverte) de capitalisation et Institutions en RMB (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | THB | 39 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | £ | 17 | 22 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNY | 9 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 03/2024 | INR | 107 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 45 | 49 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 4 862 | 33 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | INR | 370 | 4 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 2 005 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF | 13 | 15 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 32 | CNH 228 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 2 066 | \$ 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | DKK | 34 | 5 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK | 11 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK | 49 | 5 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 4 | BRL 18 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL | 18 | \$ 4 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS | 3 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 06/2024 | KRW | 2 235 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| FAR | 01/2024 | BRL | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 0 | BRL 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | MXN | 28 | \$ 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | \$ | 334 | CNH 2 383 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 18 762 | \$ 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR | 111 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD | 3 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 306 | 10 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 3 064 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | AUD | 15 | 10 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 23 | 17 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 1 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 334 | CNH 2 383 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNY | 20 | \$ 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | MYR | 4 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 38 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 1 285 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| RBC | 01/2024 | BRL 18 | \$ 4 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 19 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | MXN 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | ¥ 153 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 131 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 241 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 01/2024 | \$ 334 | CNH 2 383 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 03/2024 | INR 126 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 3 | \$ (5) | \$ (2) | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories M Détail en SGD (couverte) de capitalisation, M Détail en SGD (couverte) de distribution et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | THB 40 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | £ 17 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 106 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 45 | 49 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 4 861 | 33 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 368 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 31 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 2 028 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF 13 | 15 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD 2 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 2 091 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | AUD 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK 33 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK 11 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK 50 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 | BRL 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL 18 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNY 27 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS 2 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | \$ 333 | SGD 445 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 03/2024 | 46 | 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 2 260 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| FAR | 01/2024 | BRL 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 0 | BRL 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | MXN 28 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 333 | SGD 445 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 79 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 03/2024 | IDR 18 976 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 110 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 307 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 3 099 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | AUD 15 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 23 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 1 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | CAD 2 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR 4 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 38 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 1 299 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 01/2024 | BRL 18 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 18 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | MXN 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | \$ 333 | SGD 445 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | ¥ 211 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 131 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 240 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 03/2024 | 74 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 12 | \$ (4) | \$ 8 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (1 048) (0,16)

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/03/2054 | \$ 2 100 | \$ (2 036) | (0,30) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (2 036) | (0,30) |
| Total des Investissements | | \$ 776 011 | 115,80 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (105 895) | (15,80) |
| Actifs nets | | \$ 670 116 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

- * Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre vendu avant l'émission.
- (c) Titre à rémunération en nature.
- (d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (e) Titre à coupon zéro.
- (f) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (g) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (h) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (i) Affilié au Fonds.
- (j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : néant) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|--------------|--------|--------------|---------------------|
| Parkland Corp. | 12/12/2023 | \$ 124 | \$ 124 | 0,02 |

- (k) Un titre d'une juste valeur globale de 1 345 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 350 \$ (31 décembre 2022 : 5 030 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 5 701 \$ (31 décembre 2022 : 35 607 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 247 646 | \$ 518 134 | \$ 1 789 | \$ 767 569 |
| Fonds d'investissement | 881 | 0 | 0 | 881 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 12 604 | 0 | 12 604 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (108) | (2 899) | 0 | (3 007) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (2 036) | 0 | (2 036) |
| Totaux | \$ 248 419 | \$ 525 803 | \$ 1 789 | \$ 776 011 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 94 207 | \$ 379 228 | \$ 0 | \$ 473 435 |
| Fonds d'investissement | 151 214 | 100 275 | 0 | 251 489 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 18 536 | 0 | 18 536 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (15 794) | 1 026 | 0 | (14 768) |
| Totaux | \$ 229 627 | \$ 499 065 | \$ 0 | \$ 728 692 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (77) | \$ 0 | \$ (77) | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | (346) | 342 | (4) | (3 503) | 1 500 | (2 003) |
| BOM | S/O | S/O | S/O | 2 | 0 | 2 |
| BPS | 90 | 0 | 90 | 485 | (1 380) | (895) |
| BRC | 539 | (1 130) | (591) | (222) | 450 | 228 |
| BSH | S/O | S/O | S/O | (1) | 0 | (1) |
| CBK | (560) | 350 | (210) | 4 514 | (4 480) | 34 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (53) | 0 | (53) |
| DUB | (230) | 0 | (230) | 13 | 0 | 13 |
| FAR | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| GLM | \$ (463) | \$ (60) | \$ (523) | \$ (829) | \$ 420 | \$ (409) |
| GST | S/O | S/O | S/O | 15 | (20) | (5) |
| JPM | 114 | 0 | 114 | (36) | (590) | (626) |
| MBC | 362 | (570) | (208) | 1 039 | (1 100) | (61) |
| MEI | 28 | 0 | 28 | 7 | (440) | (433) |
| MYC | (1) | 0 | (1) | (27) | 180 | 153 |
| MYI | 231 | 0 | 231 | (55) | 780 | 725 |
| RBC | 19 | 0 | 19 | (57) | 0 | (57) |
| RYL | (444) | 732 | 288 | (21) | 0 | (21) |
| SAL | (9) | 0 | (9) | (18) | 0 | (18) |
| SCX | (266) | 271 | 5 | 4 106 | (3 980) | 126 |
| SOG | S/O | S/O | S/O | (81) | (280) | (361) |
| SSB | 33 | 0 | 33 | (463) | 590 | 127 |
| TOR | 121 | 0 | 121 | (838) | 690 | (148) |
| UAG | (190) | (320) | (510) | (549) | 420 | (129) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 80,16 | 25,87 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 34,38 | 35,98 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 1,28 |
| Fonds d'investissement | 0,13 | 33,53 |
| Contrats de mise en pension | 1,88 | 2,47 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,07) | (2,13) |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,22) | (0,30) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,16) | 0,45 |
| Titres vendus à découvert | (0,30) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Investissements à la juste valeur | | |
| Obligations et billets privés | 5,35 | 3,39 |
| Obligations et billets convertibles | 0,14 | 0,12 |
| Agences du gouvernement américain | 24,13 | 4,77 |
| Obligations du Trésor américain | 6,91 | 1,20 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 1,85 | 1,66 |
| Titres adossés à des actifs | 7,89 | 7,95 |
| Émissions souveraines | 4,16 | 7,97 |
| Actions ordinaires | 57,73 | 6,88 |
| Titres privilégiés | 0,41 | 0,16 |
| Sociétés d'investissement immobilier | 0,04 | 5,86 |
| Instruments à court terme | 5,93 | 23,17 |
| Fonds d'investissement | 0,13 | 33,53 |
| Contrats de mise en pension | 1,88 | 2,47 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,07) | (2,13) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,01) | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00 | 0,07 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,21) | (0,36) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Options plafonnées sur l'inflation | (0,04) | (0,06) |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00 | (0,01) |
| Swaps de taux d'intérêt | S/O | (0,04) |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,04) | 0,05 |
| Swaps de rendement total sur titres | S/O | 0,02 |
| Contrats de change à terme | (0,15) | (0,87) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,07 | 1,37 |
| Titres vendus à découvert | (0,30) | S/O |
| Autres actifs et passifs à court terme | (15,80) | 2,85 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES S.A. | | | | JAPON | | | |
| AUTRICHE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Erste Group Bank AG | | | | 5,875 % éch. 25/10/2033 | | | | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | | |
| 4,250 % éch. | | | | 6,316 % éch. 03/10/2029 | | | | 8,200 % éch. 15/01/2029 (d)(f) | | | |
| 15/10/2027 (d)(f) | | | | 7,250 % éch. | | | | | | | |
| € 67 800 | | | | € 11 700 | | | | € 57 300 | | | |
| \$ 64 335 | | | | € 113 400 | | | | \$ 62 313 | | | |
| 1,25 | | | | 132 978 | | | | 1,21 | | | |
| 8,500 % éch. | | | | Électricité de France S.A. | | | | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | |
| 15/10/2028 (d)(f)(h) | | | | 9,125 % éch. 15/03/2033 (d) | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 13 200 | | | | 3,337 % éch. 21/01/2033 (h) | | | | HSBC Bank Capital Funding Sterling LP | | | |
| 15 444 | | | | 6,691 % éch. 10/01/2034 | | | | 5,844 % éch. 05/11/2031 (d) | | | |
| 0,30 | | | | 8,000 % éch. | | | | £ 66 532 | | | |
| 79 779 | | | | 26 200 | | | | 88 632 | | | |
| 1,55 | | | | 27 696 | | | | 1,73 | | | |
| | | | | 29/09/2025 (d)(f) | | | | HSBC Capital Funding Dollar LP | | | |
| | | | | 10,000 % éch. 14/11/2028 (d)(f) | | | | 10,176 % éch. 30/06/2030 (d) | | | |
| | | | | 34 750 | | | | \$ 3 817 | | | |
| | | | | 19 500 | | | | 4 855 | | | |
| | | | | 20 885 | | | | 0,09 | | | |
| | | | | 643 500 | | | | 93 487 | | | |
| | | | | 12,53 | | | | 1,82 | | | |
| | | | | | | | | PAYS-BAS | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | ABN AMRO Bank NV | | | |
| | | | | | | | | 4,750 % éch. 22/09/2027 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | € 35 800 | | | |
| | | | | | | | | 36 225 | | | |
| | | | | | | | | 0,71 | | | |
| | | | | | | | | ASR Nederland NV | | | |
| | | | | | | | | 4,625 % éch. 19/10/2027 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 41 250 | | | |
| | | | | | | | | 40 782 | | | |
| | | | | | | | | 0,79 | | | |
| | | | | | | | | 7,000 % éch. 07/12/2043 | | | |
| | | | | | | | | 10 300 | | | |
| | | | | | | | | 12 871 | | | |
| | | | | | | | | 0,25 | | | |
| | | | | | | | | Athora Netherlands NV | | | |
| | | | | | | | | 7,000 % éch. 19/06/2025 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 30 165 | | | |
| | | | | | | | | 32 649 | | | |
| | | | | | | | | 0,64 | | | |
| | | | | | | | | Cooperatieve Rabobank UA | | | |
| | | | | | | | | 3,100 % éch. 29/06/2028 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 76 400 | | | |
| | | | | | | | | 69 715 | | | |
| | | | | | | | | 1,36 | | | |
| | | | | | | | | 4,375 % éch. 29/06/2027 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 29 000 | | | |
| | | | | | | | | 30 077 | | | |
| | | | | | | | | 0,59 | | | |
| | | | | | | | | 4,875 % éch. 29/06/2029 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 25 000 | | | |
| | | | | | | | | 25 004 | | | |
| | | | | | | | | 0,49 | | | |
| | | | | | | | | de Volksbank NV | | | |
| | | | | | | | | 7,000 % éch. 15/12/2027 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 35 000 | | | |
| | | | | | | | | 36 783 | | | |
| | | | | | | | | 0,72 | | | |
| | | | | | | | | ING Groep NV | | | |
| | | | | | | | | 3,875 % éch. 16/05/2027 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | \$ 51 826 | | | |
| | | | | | | | | 42 173 | | | |
| | | | | | | | | 0,82 | | | |
| | | | | | | | | 4,250 % éch. 16/05/2031 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 59 300 | | | |
| | | | | | | | | 43 281 | | | |
| | | | | | | | | 0,84 | | | |
| | | | | | | | | 4,875 % éch. 16/05/2029 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 16 700 | | | |
| | | | | | | | | 13 864 | | | |
| | | | | | | | | 0,27 | | | |
| | | | | | | | | 5,750 % éch. 16/11/2026 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 58 400 | | | |
| | | | | | | | | 54 567 | | | |
| | | | | | | | | 1,06 | | | |
| | | | | | | | | 6,750 % éch. 16/04/2024 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 5 900 | | | |
| | | | | | | | | 5 879 | | | |
| | | | | | | | | 0,11 | | | |
| | | | | | | | | 7,500 % éch. 16/05/2028 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 27 700 | | | |
| | | | | | | | | 27 723 | | | |
| | | | | | | | | 0,54 | | | |
| | | | | | | | | NN Group NV | | | |
| | | | | | | | | 5,250 % éch. 01/03/2043 | | | |
| | | | | | | | | € 21 500 | | | |
| | | | | | | | | 24 328 | | | |
| | | | | | | | | 0,47 | | | |
| | | | | | | | | Stichting AK Rabobank Certificaten | | | |
| | | | | | | | | 6,500 % (d) | | | |
| | | | | | | | | 149 837 | | | |
| | | | | | | | | 166 188 | | | |
| | | | | | | | | 3,23 | | | |
| | | | | | | | | Total Pays-Bas | | | |
| | | | | | | | | 662 109 | | | |
| | | | | | | | | 12,89 | | | |
| | | | | | | | | PORTUGAL | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Banco Espírito Santo S.A. | | | |
| | | | | | | | | 2,625 % éch. 08/05/2017 ^ | | | |
| | | | | | | | | 26 300 | | | |
| | | | | | | | | 7 989 | | | |
| | | | | | | | | 0,15 | | | |
| | | | | | | | | 4,000 % éch. 21/01/2019 ^ | | | |
| | | | | | | | | 11 100 | | | |
| | | | | | | | | 3 372 | | | |
| | | | | | | | | 0,07 | | | |
| | | | | | | | | 4,750 % éch. 15/01/2018 ^ | | | |
| | | | | | | | | 20 000 | | | |
| | | | | | | | | 6 076 | | | |
| | | | | | | | | 0,12 | | | |
| | | | | | | | | Total Portugal | | | |
| | | | | | | | | 17 437 | | | |
| | | | | | | | | 0,34 | | | |
| | | | | | | | | SLOVÉNIE | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Nova Ljubljanska Banka d.d. | | | |
| | | | | | | | | 3,650 % éch. 19/11/2029 | | | |
| | | | | | | | | 5 900 | | | |
| | | | | | | | | 5 738 | | | |
| | | | | | | | | 0,11 | | | |
| | | | | | | | | 10,750 % éch. 28/11/2032 | | | |
| | | | | | | | | 16 900 | | | |
| | | | | | | | | 20 393 | | | |
| | | | | | | | | 0,40 | | | |
| | | | | | | | | Total Slovénie | | | |
| | | | | | | | | 26 131 | | | |
| | | | | | | | | 0,51 | | | |
| | | | | | | | | ESPAGNE | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | |
| | | | | | | | | 6,000 % éch. 29/03/2024 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 14 600 | | | |
| | | | | | | | | 16 115 | | | |
| | | | | | | | | 0,31 | | | |
| | | | | | | | | 6,000 % éch. 15/01/2026 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 9 600 | | | |
| | | | | | | | | 10 564 | | | |
| | | | | | | | | 0,21 | | | |
| | | | | | | | | 7,883 % éch. 15/11/2034 | | | |
| | | | | | | | | \$ 29 000 | | | |
| | | | | | | | | 31 574 | | | |
| | | | | | | | | 0,61 | | | |
| | | | | | | | | 8,375 % éch. 21/06/2028 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | € 28 000 | | | |
| | | | | | | | | 33 598 | | | |
| | | | | | | | | 0,65 | | | |
| | | | | | | | | 9,375 % éch. 19/03/2029 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | € 56 800 | | | |
| | | | | | | | | 60 895 | | | |
| | | | | | | | | 1,19 | | | |
| | | | | | | | | Banco de Credito Social Cooperativo S.A. | | | |
| | | | | | | | | 1,750 % éch. 09/03/2028 | | | |
| | | | | | | | | € 11 300 | | | |
| | | | | | | | | 11 021 | | | |
| | | | | | | | | 0,21 | | | |
| | | | | | | | | Banco Santander S.A. | | | |
| | | | | | | | | 3,625 % éch. 21/03/2029 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 35 000 | | | |
| | | | | | | | | 28 990 | | | |
| | | | | | | | | 0,56 | | | |
| | | | | | | | | 4,125 % éch. 12/11/2027 (d)(f)(h) | | | |
| | | | | | | | | 49 000 | | | |
| | | | | | | | | 46 509 | | | |
| | | | | | | | | 0,91 | | | |
| | | | | | | | | 4,375 % éch. 14/01/2026 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 52 400 | | | |
| | | | | | | | | 53 425 | | | |
| | | | | | | | | 1,04 | | | |
| | | | | | | | | 9,625 % éch. 21/11/2028 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | \$ 20 200 | | | |
| | | | | | | | | 21 694 | | | |
| | | | | | | | | 0,42 | | | |
| | | | | | | | | 9,625 % éch. 21/05/2033 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 32 600 | | | |
| | | | | | | | | 35 697 | | | |
| | | | | | | | | 0,70 | | | |
| | | | | | | | | Bankinter S.A. | | | |
| | | | | | | | | 6,250 % éch. 17/01/2026 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | € 10 600 | | | |
| | | | | | | | | 11 706 | | | |
| | | | | | | | | 0,23 | | | |
| | | | | | | | | 7,375 % éch. 15/08/2028 (d)(f) | | | |
| | | | | | | | | 8 400 | | | |
| | | | | | | | | 9 441 | | | |
| | | | | | | | | 0,18 | | | |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| CaixaBank S.A. | | | | 8,500 % éch. 27/03/2028 (d)(f) | £ 34 600 | \$ 44 640 | 0,87 | 5,364 % éch. | | | |
| 3,625 % éch. 14/09/2028 (d)(f) € | 44 600 | \$ 38 156 | 0,74 | Nationwide Building Society | | | | 16/04/2024 (b)(c) | \$ 4 000 | \$ 3 939 | 0,08 |
| 5,250 % éch. 23/03/2026 (d)(f) | 6 200 | 6 382 | 0,12 | 5,750 % éch. 20/06/2027 (d)(f) | 22 270 | 26 253 | 0,51 | 5,365 % éch. | | | |
| 5,875 % éch. 09/10/2027 (d)(f) | 8 400 | 9 013 | 0,18 | NatWest Group PLC | | | | 08/02/2024 (b)(c) | 50 700 | 50 426 | 0,98 |
| 6,750 % éch. 13/06/2024 (d)(f) | 46 000 | 50 858 | 0,99 | 4,445 % éch. 08/05/2030 | \$ 33 800 | 32 417 | 0,63 | 5,369 % éch. | | | |
| 8,250 % éch. 13/03/2029 (d)(f) | 46 200 | 54 199 | 1,06 | 4,500 % éch. 31/03/2028 (d)(f) £ | 12 400 | 13 269 | 0,26 | 14/03/2024 (b)(c)(i) | 4 400 | 4 354 | 0,09 |
| Total Espagne | | 529 837 | 10,31 | 4,600 % éch. 28/06/2031 (d)(f) \$ | 21 859 | 16 458 | 0,32 | 5,373 % éch. | 27 100 | 26 870 | 0,52 |
| SUÈDE | | | | 4,892 % éch. 18/05/2029 | 43 026 | 42 292 | 0,82 | 5,374 % éch. | 6 100 | 6 031 | 0,12 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,076 % éch. 27/01/2030 (h) | 11 500 | 11 334 | 0,22 | 21/03/2024 (b)(c) | | | |
| Svenska Handelsbanken AB | | | | 6,000 % éch. 29/12/2025 (d)(f) | 70 800 | 68 627 | 1,34 | 5,376 % éch. | | | |
| 4,750 % éch. 01/03/2031 (d)(f) \$ | 29 600 | 24 485 | 0,48 | 8,000 % éch. 10/08/2025 (d)(f) | 39 900 | 40 070 | 0,78 | 09/01/2024 (b)(c) | 2 700 | 2 697 | 0,05 |
| SUISSE | | | | Santander UK Group Holdings PLC | | | | 5,377 % éch. | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,896 % éch. 15/03/2032 | 1 600 | 1 368 | 0,03 | 07/03/2024 (b)(c)(i) | 3 000 | 2 972 | 0,06 |
| Credit Suisse AG | | | | 6,534 % éch. 10/01/2029 | 14 600 | 15 123 | 0,29 | 5,377 % éch. | | | |
| 0,495 % éch. 02/02/2024 | 600 | 597 | 0,01 | 6,750 % éch. 24/06/2024 (d)(f) £ | 86 735 | 110 665 | 2,16 | 28/03/2024 (b)(c) | 13 100 | 12 937 | 0,25 |
| 1,250 % éch. 07/08/2026 | 500 | 454 | 0,01 | 7,482 % éch. 29/08/2029 | 8 200 | 11 377 | 0,22 | 5,378 % éch. | | | |
| 4,750 % éch. 09/08/2024 | 250 | 249 | 0,00 | Standard Chartered PLC | | | | 11/01/2024 (b)(c) | 49 800 | 49 735 | 0,97 |
| 5,000 % éch. 09/07/2027 | 1 100 | 1 101 | 0,02 | 6,296 % éch. 06/07/2034 | \$ 2 600 | 2 732 | 0,05 | 23/01/2024 (b)(c) | 22 000 | 21 932 | 0,43 |
| 7,500 % éch. 15/02/2028 | 5 550 | 6 082 | 0,12 | Thames Water Utilities Finance PLC | | | | 5,383 % éch. | | | |
| 7,950 % éch. 09/01/2025 | 250 | 256 | 0,01 | 8,250 % éch. 25/04/2040 | £ 2 600 | 3 728 | 0,07 | 30/01/2024 (b)(c) | 7 400 | 7 370 | 0,14 |
| UBS AG | | | | Virgin Money UK PLC | | | | 5,384 % éch. | | | |
| 5,125 % éch. 15/05/2024 (f) | 5 000 | 4 965 | 0,10 | 8,250 % éch. 17/06/2027 (d)(f) | 19 300 | 22 774 | 0,44 | 15/02/2024 (a)(b)(c) | 6 000 | 5 962 | 0,12 |
| UBS Group AG | | | | 11,000 % éch. 08/12/2028 (d)(f) | 18 300 | 23 883 | 0,47 | 5,385 % éch. | | | |
| 2,593 % éch. 11/09/2025 | 850 | 832 | 0,02 | | | | | 11/01/2024 (b)(c) | 35 000 | 34 954 | 0,68 |
| 2,746 % éch. 11/02/2033 (h) | 11 570 | 9 497 | 0,18 | | | | | 5,385 % éch. | | | |
| 3,091 % éch. 14/05/2032 (h) | 4 500 | 3 835 | 0,07 | | | | | 16/04/2024 (b)(c) | 7 500 | 7 386 | 0,14 |
| 3,750 % éch. 26/03/2025 | 700 | 686 | 0,01 | | | | | 5,394 % éch. | | | |
| 3,869 % éch. 12/01/2029 | 300 | 283 | 0,01 | TITRES PRIVILÉGIÉS | | | | 23/01/2024 (b)(c) | 3 300 | 3 290 | 0,06 |
| 4,194 % éch. 01/04/2031 (h) | 36 000 | 33 552 | 0,65 | Nationwide Building Society | | | | 5,400 % éch. | | | |
| 4,282 % éch. 09/01/2028 | 300 | 291 | 0,01 | 10,250 % | 566 146 | 94 035 | 1,83 | 02/01/2024 (b)(c) | 3 100 | 3 100 | 0,06 |
| 4,375 % éch. 10/02/2031 (d)(f)(h) | 35 835 | 28 391 | 0,55 | Total Royaume-Uni | | 1 099 026 | 21,40 | 5,400 % éch. | | | |
| 4,375 % éch. 10/02/2031 (d)(f) | 4 900 | 3 882 | 0,08 | | | | | 15/02/2024 (a)(b)(c) | 6 200 | 6 160 | 0,12 |
| 4,550 % éch. 17/04/2026 | 200 | 197 | 0,00 | | | | | 5,410 % éch. | | | |
| 4,875 % éch. 12/02/2027 (d)(f) | 41 000 | 37 032 | 0,72 | | | | | 22/02/2024 (b)(c)(i) | 2 600 | 2 581 | 0,05 |
| 4,875 % éch. 12/02/2027 (d)(f)(h) | 41 600 | 37 574 | 0,73 | | | | | 5,418 % éch. | | | |
| 5,959 % éch. 12/01/2034 (h) | 5 400 | 5 587 | 0,11 | | | | | 02/01/2024 (b)(c) | 24 000 | 24 000 | 0,47 |
| 5,959 % éch. 12/01/2034 | 700 | 724 | 0,01 | | | | | 5,430 % éch. | | | |
| 6,373 % éch. 15/07/2026 | 850 | 860 | 0,02 | ÉTATS-UNIS | | | | 01/02/2024 (b)(c) | 4 400 | 4 381 | 0,09 |
| 6,442 % éch. 11/08/2028 | 2 500 | 2 598 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,446 % éch. | | | |
| 6,537 % éch. 12/08/2033 (h) | 11 050 | 11 799 | 0,23 | Bank of America Corp. | | | | 18/01/2024 (b)(c) | 38 700 | 38 609 | 0,75 |
| 7,750 % éch. 01/03/2029 € | 11 600 | 14 785 | 0,29 | 4,376 % éch. 27/04/2028 | \$ 1 000 | 978 | 0,02 | 5,450 % éch. | | | |
| 9,016 % éch. 15/11/2033 (h) \$ | 650 | 799 | 0,02 | 4,948 % éch. 22/07/2028 | 400 | 400 | 0,01 | 25/01/2024 (b)(c) | 2 100 | 2 093 | 0,04 |
| 9,250 % éch. 13/11/2028 (d)(f) | 19 050 | 20 598 | 0,40 | 5,202 % éch. 25/04/2029 | 25 400 | 25 573 | 0,50 | 5,458 % éch. | | | |
| 9,250 % éch. 13/11/2033 (d)(f) | 17 700 | 19 661 | 0,38 | Credit Suisse AG AT1 Claim | 254 548 | 30 540 | 0,59 | 25/01/2024 (b)(c) | 7 800 | 7 774 | 0,15 |
| Total Suisse | | 247 167 | 4,81 | Deutsche Postbank Funding Trust | | | | 5,473 % éch. | | | |
| ROYAUME-UNI | | | | 2,944 % éch. 02/06/2024 (d) € | 1 704 | 1 428 | 0,03 | 27/02/2024 (b)(c) | 14 200 | 14 083 | 0,27 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,125 % éch. 07/06/2024 (d) | 12 980 | 10 908 | 0,21 | 5,479 % éch. | | | |
| Barclays PLC | | | | Doctors Co. An Interinsurance Exchange | | | | 18/01/2024 (b)(c) | 23 200 | 23 146 | 0,45 |
| 2,894 % éch. 24/11/2032 | 200 | 164 | 0,00 | 4,500 % éch. 18/01/2032 (h) \$ | 3 400 | 2 712 | 0,05 | 5,480 % éch. | | | |
| 6,125 % éch. 15/12/2025 (d)(f) | 18 783 | 17 989 | 0,35 | Goldman Sachs Group, Inc. | | | | 04/01/2024 (b)(c) | 4 000 | 3 999 | 0,08 |
| 7,125 % éch. 15/06/2025 (d)(f) £ | 34 150 | 42 452 | 0,83 | 3,615 % éch. 15/03/2028 | 21 100 | 20 245 | 0,39 | 5,486 % éch. | | | |
| 8,000 % éch. 15/06/2024 (d)(f) \$ | 45 824 | 45 624 | 0,89 | JPMorgan Chase & Co. | | | | 20/02/2024 (b)(c) | 15 200 | 15 091 | 0,29 |
| 9,250 % éch. 15/09/2028 (d)(f) £ | 18 800 | 23 946 | 0,47 | 3,509 % éch. 23/01/2029 | 200 | 190 | 0,00 | 5,489 % éch. | | | |
| 9,625 % éch. 15/12/2029 (d)(f) \$ | 36 950 | 38 474 | 0,75 | Liberty Mutual Group, Inc. | | | | 23/01/2024 (b)(c) | 80 600 | 80 353 | 1,56 |
| Bupa Finance PLC | | | | 3,625 % éch. 23/05/2059 | € 15 500 | \$ 16 763 | 0,33 | 5,514 % éch. | | | |
| 4,000 % éch. 24/09/2031 (d)(f) £ | 6 600 | 5 676 | 0,11 | Morgan Stanley | | | | 30/01/2024 (b)(c) | 28 700 | 28 582 | 0,56 |
| HSBC Holdings PLC | | | | 5,123 % éch. 01/02/2029 | \$ 21 443 | 21 553 | 0,42 | 5,517 % éch. | | | |
| 2,804 % éch. 24/05/2032 | \$ 200 | 167 | 0,00 | 5,948 % éch. 19/01/2038 (h) | 23 400 | 23 674 | 0,46 | 06/02/2024 (a)(b)(c) | 31 400 | 31 239 | 0,61 |
| 5,875 % éch. 28/09/2026 (d)(f) £ | 200 | 243 | 0,01 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | | | | Total des Instruments à court terme | 585 302 | 11,39 | |
| 6,000 % éch. 22/05/2027 (d)(f) \$ | 18 600 | 17 811 | 0,35 | 5,650 % éch. 01/05/2079 (h) | 8 224 | 7 758 | 0,15 | Total des Valeurs mobilières | \$ 5 268 327 | 102,55 | |
| 6,161 % éch. 09/03/2029 | 20 000 | 20 665 | 0,40 | Wells Fargo & Co. | | | | ACTIONS | | | |
| 6,254 % éch. 09/03/2034 (h) | 1 000 | 1 063 | 0,02 | 2,393 % éch. 02/06/2028 | 300 | 275 | 0,01 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| 6,332 % éch. 09/03/2044 (h) | 9 100 | 9 819 | 0,19 | | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 6,375 % éch. 30/03/2025 (d)(f) | 4 800 | 4 745 | 0,09 | Total États-Unis | | 162 997 | 3,17 | PIMCO Select Funds | | | |
| 8,201 % éch. 16/11/2034 | £ 34 800 | 49 033 | 0,96 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | plc - Fonds PIMCO | | | |
| Lloyds Banking Group PLC | | | | BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | US Dollar Short-Term | | | |
| 4,947 % éch. 27/06/2025 (d)(f) € | 78 622 | 84 928 | 1,65 | 5,355 % éch. | | | | Floating NAV | | | |
| 7,500 % éch. 27/06/2024 (d)(f) \$ | 23 450 | 23 247 | 0,45 | 28/03/2024 (b)(c) | 60 000 | 59 256 | 1,15 | Fund (e) | 14 763 | 147 | 0,00 |
| 7,500 % éch. 27/09/2025 (d)(f) | 24 591 | 24 143 | 0,47 | | | | | Total des Fonds d'investissement | \$ 147 | 0,00 | |
| 7,875 % éch. 27/06/2029 (d)(f) £ | 52 654 | 65 824 | 1,28 | | | | | | | | |
| 8,000 % éch. 27/09/2029 (d)(f) \$ | 41 780 | 41 968 | 0,82 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-----------------------------|------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 7 572 | Billets du Trésor américain | \$ (7 724) | \$ 7 572 | \$ 7 574 | 0,15 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (7 724) | \$ 7 572 | \$ 7 574 | 0,15 |

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 215 | \$ 885 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 1 230 | (2 630) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 170 | 5 513 | 0,11 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 94 | (1 179) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 1 551 | (6 603) | (0,13) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 326 | 2 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 5 017 | 8 023 | 0,16 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 3 509 | (7 696) | (0,15) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 5 035 | 17 595 | 0,34 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 312 | 240 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 155 | 1 235 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 332 | 3 793 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 467 | 4 093 | 0,08 |
| | | | | \$ 23 271 | 0,45 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 23 271 | 0,45 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 0,750 % | 15/09/2051 | £ 3 800 | \$ 1 167 | 0,02 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 28 000 | (4 585) | (0,09) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 90 400 | (9 163) | (0,18) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 104 800 | (6 553) | (0,13) |
| À payer ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 21 300 | 678 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | \$ 59 300 | (368) | (0,01) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 63 600 | (7 235) | (0,14) |
| | | | | | \$ (26 059) | (0,51) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (26 059) | (0,51) |

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | AUD | 952 | \$ 630 | \$ 0 | \$ (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 28 241 | 35 826 | 0 | (177) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 42 | CNY 295 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € | 1 539 682 | \$ 1 694 164 | 0 | (7 037) | (0,15) |
| | 01/2024 | £ | 88 458 | 112 058 | 5 | (712) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ | 1 109 | CAD 1 491 | 22 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 24 261 | € 22 217 | 314 | (28) | 286 |
| CBK | 02/2024 | € | 74 | CNY 526 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 7 419 | \$ 8 124 | 0 | (73) | (0,00) |
| | 01/2024 | £ | 3 899 | 4 936 | 0 | (34) | (0,00) |
| | 01/2024 | \$ | 12 507 | € 11 452 | 149 | (2) | 147 |
| DUB | 01/2024 | € | 5 539 | £ 4 368 | 30 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD | 1 829 | \$ 1 382 | 0 | (10) | (0,00) |
| GLM | 01/2024 | CAD | 22 312 | 16 418 | 0 | (504) | (0,01) |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|-------------|--------|
| JPM | 01/2024 | \$ | 3 379 | £ | 2 652 | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 145 | SGD | 192 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 304 960 | \$ | 333 440 | 0 | (3 511) | (3 511) | (0,07) |
| MBC | 01/2024 | £ | 7 991 | | 10 077 | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 21 565 | € | 19 708 | 211 | 0 | 211 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 552 | £ | 2 008 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | € | 4 020 | \$ | 4 465 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 706 | | 902 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 243 | € | 219 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | | 2 276 | £ | 1 796 | 15 | (2) | 13 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 61 | SGD | 81 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 44 | CNY | 308 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | | 24 261 | £ | 19 300 | 344 | 0 | 344 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 2 | SGD | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 106 | \$ | 115 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 386 823 | | 489 468 | 0 | (3 670) | (3 670) | (0,07) |
| | 01/2024 | SEK | 4 575 | | 443 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | | | | | | \$ 1 127 | \$ (15 910) | \$ (14 783) | (0,30) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Investisseurs en AUD (couverte) de distribution et Z en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|----------|------|
| AZD | 01/2024 | \$ | 32 079 | AUD | 48 379 | \$ 939 | \$ 0 | \$ 939 | 0,02 |
| BOA | 01/2024 | | 2 438 | | 3 685 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD | 572 | \$ | 389 | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | \$ | 113 | AUD | 168 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD | 184 | \$ | 121 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | | 350 | | 231 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ | 598 | AUD | 885 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD | 369 | \$ | 247 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | | 25 | | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | \$ | 12 133 | AUD | 18 301 | 357 | 0 | 357 | 0,01 |
| | 01/2024 | AUD | 167 | \$ | 112 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ | 15 435 | AUD | 23 264 | 442 | 0 | 442 | 0,01 |
| | | | | | | \$ 1 824 | \$ (20) | \$ 1 804 | 0,04 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en BRL (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|---------|------|
| BOA | 01/2024 | BRL | 18 667 | \$ | 3 806 | \$ 0 | \$ (37) | \$ (37) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 3 771 | BRL | 18 558 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 3 806 | | 18 745 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | BRL | 827 | \$ | 169 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 570 | BRL | 2 783 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 133 | | 650 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL | 20 824 | \$ | 4 216 | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 4 335 | BRL | 21 286 | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 4 207 | | 20 866 | 81 | 0 | 81 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | BRL | 1 934 | \$ | 401 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 472 | BRL | 2 333 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 400 | | 1 934 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | BRL | 24 565 | \$ | 4 982 | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 4 387 | BRL | 21 374 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 4 170 | | 20 620 | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | | 99 | | 482 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 321 | \$ (185) | \$ 136 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en CAD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|-------|------|
| BRC | 01/2024 | \$ | 918 | CAD | 1 249 | \$ 29 | \$ 0 | \$ 29 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | | 23 | | 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD | 46 | \$ | 35 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 007 | CAD | 1 369 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | | 114 | | 154 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | CAD | 46 | \$ | 35 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ | 92 | CAD | 121 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 011 | | 1 371 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 92 | \$ 0 | \$ 92 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 31 | \$ 36 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 453 | 524 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 770 | CHF 1 544 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | CHF 69 | \$ 79 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 14 580 | CHF 12 701 | 519 | 0 | 519 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | CHF 41 | \$ 48 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 15 568 | CHF 13 642 | 650 | 0 | 650 | 0,02 |
| MYI | 01/2024 | 15 706 | 13 710 | 592 | 0 | 592 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 826 | \$ (20) | \$ 1 806 | 0,04 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de distribution et T en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 9 956 | \$ 10 788 | \$ 0 | \$ (213) | \$ (213) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 801 692 | € 728 946 | 3 757 | (32) | 3 725 | 0,07 |
| BRC | 01/2024 | 698 011 | 634 682 | 3 252 | 0 | 3 252 | 0,06 |
| CBK | 01/2024 | € 8 445 | \$ 9 282 | 11 | (61) | (50) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 318 | € 5 744 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 13 691 | \$ 14 948 | 0 | (180) | (180) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 644 683 | € 589 546 | 6 711 | 0 | 6 711 | 0,13 |
| | | | | \$ 13 760 | \$ (486) | \$ 13 274 | 0,26 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de distribution et R en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 10 | \$ 13 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 7 682 | £ 6 062 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 8 | \$ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 398 | £ 6 621 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 146 | 116 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 329 | \$ 417 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 23 | £ 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 64 | 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 1 151 | \$ 1 464 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 1 159 | £ 914 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 215 | \$ 275 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | £ 48 407 | \$ 38 270 | 381 | 0 | 381 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | £ 32 046 | \$ 25 396 | 331 | 0 | 331 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | £ 56 | \$ 70 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 48 397 | £ 38 242 | 355 | 0 | 355 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 163 | \$ (8) | \$ 1 155 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, Administrations en SGD (couverte) de distribution II et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| DUB | 01/2024 | \$ 23 418 | SGD 31 129 | \$ 188 | \$ 0 | \$ 188 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SGD 411 | \$ 308 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 468 | SGD 8 687 | 119 | 0 | 119 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | 4 996 | 6 663 | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD 558 | \$ 417 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 613 | SGD 817 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 76 | \$ 57 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | \$ 21 943 | SGD 29 270 | 253 | 0 | 253 | 0,01 |
| | 02/2024 | SGD 510 | \$ 387 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | \$ 20 933 | SGD 27 930 | 246 | 0 | 246 | 0,01 |
| | 02/2024 | SGD 134 | \$ 101 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 870 | \$ (10) | \$ 860 | 0,02 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 4 344 0,08

Total des Investissements

\$ 5 277 602 102,72

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (139 716) (2,72)

Actifs nets

\$ 5 137 886 100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

- * Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à coupon zéro.
- (c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (e) Affilié au Fonds.
- (f) Titre convertible conditionnel.
- (g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,66 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------|-----------------|-------------------------|------------------|------------------|---------------------|
| Alice France S.A. | 11,500 % | 01/02/2027 | 20/12/2023 | \$ 532 | \$ 556 | 0,01 |
| Bank of Nova Scotia | 3,625 | 27/10/2081 | 29/09/2021 | 18 500 | 14 253 | 0,28 |
| Deutsche Bank AG | 3,729 | 14/01/2032 | 17/10/2023 - 24/01/2023 | 10 595 | 11 302 | 0,22 |
| | | | | <u>\$ 29 627</u> | <u>\$ 26 111</u> | <u>0,51</u> |

- (h) Des titres d'une juste valeur globale de 275 063 \$ (31 décembre 2022 : 627 510 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.
- (i) Des titres d'une juste valeur globale de 4 406 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 8 850 \$ (31 décembre 2022 : 29 992 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 7 385 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 12 629 \$ (31 décembre 2022 : 18 271 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 46 179 \$ (31 décembre 2022 : 80 890 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 5 267 319 | \$ 1 008 | \$ 5 268 327 |
| Fonds d'investissement | 147 | 0 | 0 | 147 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 7 572 | 0 | 7 572 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 80 | 1 476 | 0 | 1 556 |
| Totaux | \$ 227 | \$ 5 276 367 | \$ 1 008 | \$ 5 277 602 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 6 129 600 | \$ 0 | \$ 6 129 600 |
| Fonds d'investissement | 140 | 0 | 0 | 140 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 10 172 | 0 | 10 172 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 25 386 | (4 310) | 0 | 21 076 |
| Totaux | \$ 25 526 | \$ 6 135 462 | \$ 0 | \$ 6 160 988 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|--------------|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 3,800 % | 13/10/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (2 013) | \$ (2 242) | (0,04) |
| | 6,120 | 07/07/2023 | 04/01/2024 | \$ (31 031) | (31 918) | (0,62) |
| BRC | 3,950 | 20/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (4 620) | (5 159) | (0,10) |
| | 5,870 | 11/10/2023 | 11/04/2024 | \$ (28 999) | (29 387) | (0,57) |
| JPS | 6,010 | 03/10/2023 | 03/01/2024 | (28 876) | (29 310) | (0,57) |
| | 6,010 | 28/11/2023 | 03/01/2024 | (1 919) | (1 930) | (0,04) |
| | 6,010 | 07/12/2023 | 03/01/2024 | (11 613) | (11 661) | (0,23) |
| MYI | 3,500 | 16/10/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (12 002) | (13 355) | (0,26) |

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| RCE | 4,500 % | 25/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (2 346) | \$ (2 375) | (0,05) |
| SCX | 5,880 | 10/11/2023 | 08/02/2024 | (51 882) | (52 323) | (1,02) |
| WFS | 5,870 | 11/10/2023 | 09/01/2024 | (51 852) | (52 545) | (1,02) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (232 205) | (4,52) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 939 | \$ (980) | \$ (41) | \$ 137 | \$ 0 | \$ 137 |
| BOA | (14) | 0 | (14) | 1 028 | (1 010) | 18 |
| BPS | (3 885) | 8 850 | 4 965 | (1 308) | 1 490 | 182 |
| BRC | 3 327 | (7 000) | (3 673) | 37 | (10) | 27 |
| CBK | 619 | (610) | 9 | 6 857 | (6 830) | 27 |
| DUB | 178 | 0 | 178 | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 298 | (320) | (22) | 352 | (400) | (48) |
| GST | S/O | S/O | S/O | (268) | 262 | (6) |
| JPM | 65 | 0 | 65 | 175 | (340) | (165) |
| MBC | 3 492 | (5 190) | (1 698) | 14 804 | (13 250) | 1 554 |
| MYI | 884 | (980) | (96) | 771 | (650) | 121 |
| RBC | S/O | S/O | S/O | 34 | 0 | 34 |
| RYL | (2) | 0 | (2) | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 725 | (960) | (235) | (28 111) | 26 890 | (1 221) |
| SSB | 331 | (450) | (119) | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 246 | 0 | 246 | (140) | 1 350 | 1 210 |
| UAG | (2 859) | 4 406 | 1 547 | (147) | 0 | (147) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 93,20 | 82,69 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 8,76 | 24,44 |
| Autres valeurs mobilières | 0,59 | S/O |
| Fonds d'investissement | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de mise en pension | 0,15 | 0,18 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,45 | 0,42 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,51) | 0,05 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,08 | (0,10) |
| Contrats de prise en pension | (4,52) | (10,11) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Autriche | 1,55 | 1,85 |
| Belgique | 2,61 | 1,41 |
| Canada | 1,31 | 1,20 |
| Îles Caïmans | S/O | 0,11 |
| Chine | S/O | 0,01 |
| Danemark | 0,06 | 0,44 |
| Finlande | 0,87 | 0,82 |
| France | 12,53 | 13,26 |
| Allemagne | 2,70 | 3,81 |
| Hong Kong | S/O | 0,12 |
| Irlande | 3,99 | 3,56 |
| Israël | S/O | 0,26 |
| Italie | 8,60 | 7,66 |
| Japon | 1,21 | S/O |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 1,82 | 1,51 |
| Luxembourg | S/O | 0,64 |
| Mexique | S/O | 0,71 |
| Pays-Bas | 12,89 | 15,07 |
| Norvège | S/O | 0,36 |
| Portugal | 0,34 | 0,16 |
| Slovénie | 0,51 | 0,60 |
| Espagne | 10,31 | 8,65 |
| Suède | 0,48 | 0,72 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Suisse | 4,81 | 7,67 |
| Royaume-Uni | 21,40 | 18,81 |
| États-Unis | 3,17 | 1,51 |
| Instruments à court terme | 11,39 | 16,21 |
| Fonds d'investissement | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de mise en pension | 0,15 | 0,18 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,45 | 0,42 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | (0,03) |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,51) | 0,08 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | (0,04) |
| Contrats de change à terme | (0,30) | (1,11) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,38 | 1,05 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (2,72) | (7,68) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | FINLANDE | | | | DESCRIPTION | | | |
| AUSTRALIE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Nokia Oyj | | | | 1,375 % éch. 07/06/2032 € 15 600 \$ 15 787 6,02 | | | |
| GPT Wholesale Office Fund | | | | 4,375 % éch. 21/08/2031 € 500 \$ 556 0,21 | | | | 2,000 % éch. 15/11/2029 10 400 11 225 4,28 | | | |
| 3,222 % éch. 05/11/2031 AUD 500 \$ 272 0,11 | | | | Nordea Bank Abp | | | | Landwirtschaftliche Rentenbank | | | |
| Lendlease Finance Ltd. | | | | 6,000 % éch. 02/06/2026 £ 1 800 2 320 0,88 | | | | 3,250 % éch. 26/09/2033 1 200 1 403 0,54 | | | |
| 3,400 % éch. 27/10/2027 930 577 0,22 | | | | Tornator Oyj | | | | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG | | | |
| 3,700 % éch. 31/03/2031 200 112 0,04 | | | | 1,250 % éch. 14/10/2026 € 200 207 0,08 | | | | in Muenchen | | | |
| Total Australie 961 0,37 | | | | 3 083 1,17 | | | | 1,000 % éch. 26/05/2042 700 612 0,23 | | | |
| AUTRICHE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ZF Finance GmbH | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Kuntarahoitus Oyj | | | | 2,000 % éch. 25/09/2028 500 566 0,22 | | | |
| UniCredit Bank Austria AG | | | | 3,000 % éch. 25/09/2028 500 566 0,22 | | | | 2,250 % éch. 03/05/2028 600 610 0,23 | | | |
| 3,125 % éch. 21/09/2029 € 600 674 0,25 | | | | Total Finlande 3 649 1,39 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | FRANCE | | | | République d'Allemagne | | | |
| Obligation internationale du gouvernement autrichien | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 0,000 % éch. 15/08/2031 (a) 1 400 1 340 0,51 | | | |
| 1,850 % éch. 23/05/2049 750 678 0,26 | | | | AXA S.A. | | | | État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie | | | |
| Total Autriche 1 352 0,51 | | | | 5,500 % éch. 11/07/2043 400 474 0,18 | | | | 0,000 % éch. 12/10/2035 (a) 20 16 0,01 | | | |
| BELGIQUE | | | | Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. | | | | 1 356 0,52 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 0,250 % éch. 29/06/2028 100 97 0,04 | | | | Total Allemagne 36 365 13,86 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement belge | | | | BNP Paribas S.A. | | | | INDE | | | |
| 2,750 % éch. 22/04/2039 700 755 0,29 | | | | 1,675 % éch. 30/06/2027 \$ 500 458 0,18 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap | | | | 4,625 % éch. 25/02/2031 (b)(c) 1 000 808 0,31 | | | | JSW Hydro Energy Ltd. | | | |
| 3,250 % éch. 12/01/2043 500 548 0,21 | | | | CNP Assurances SACA | | | | 4,125 % éch. 18/05/2031 \$ 1 127 983 0,37 | | | |
| Total Belgique 1 303 0,50 | | | | 2,000 % éch. 27/07/2050 € 200 192 0,07 | | | | ReNew Wind Energy AP2 | | | |
| BRÉSIL | | | | 4,875 % éch. 07/10/2030 (b)(c) \$ 800 630 0,24 | | | | 4,500 % éch. 14/07/2028 1 700 1 513 0,58 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Crédit Agricole S.A. | | | | Total Inde 2 496 0,95 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | 0,125 % éch. 09/12/2027 € 100 98 0,04 | | | | IRLANDE | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 \$ 200 208 0,08 | | | | 4,375 % éch. 27/11/2033 800 930 0,35 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| CANADA | | | | 6,316 % éch. 03/10/2029 \$ 500 524 0,20 | | | | AIB Group PLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Île-de-France Mobilités | | | | 2,875 % éch. 30/05/2031 € 600 636 0,24 | | | |
| Brookfield Property Finance ULC | | | | 0,400 % éch. 28/05/2031 € 800 749 0,29 | | | | 4,625 % éch. 23/07/2029 1 300 1 484 0,57 | | | |
| 7,125 % éch. 13/02/2028 (d) CAD 700 522 0,20 | | | | Kering S.A. | | | | Bank of Ireland Group PLC | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,125 % éch. 23/11/2026 £ 1 500 1 952 0,74 | | | | 5,000 % éch. 04/07/2031 400 473 0,18 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement canadien | | | | SEB S.A. | | | | 7,594 % éch. 06/12/2032 £ 600 798 0,30 | | | |
| 2,250 % éch. 01/12/2029 6 400 4 647 1,77 | | | | 1,375 % éch. 16/06/2025 € 600 638 0,24 | | | | Smurfit Kappa Treasury ULC | | | |
| Total Canada 5 169 1,97 | | | | Société Générale S.A. | | | | 0,500 % éch. 22/09/2029 € 1 000 947 0,36 | | | |
| CHILI | | | | 0,625 % éch. 02/12/2027 1 200 1 216 0,46 | | | | Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 8 766 3,34 | | | | 3,000 % éch. 19/04/2051 \$ 650 529 0,20 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement chilien | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 3,500 % éch. 02/05/2052 1 200 986 0,38 | | | |
| 0,830 % éch. 02/07/2031 € 2 100 1 926 0,73 | | | | Agence Française de Développement | | | | Total Irlande 5 853 2,23 | | | |
| 3,500 % éch. 15/04/2053 \$ 400 302 0,12 | | | | 1,375 % éch. 17/09/2024 1 000 1 088 0,42 | | | | ITALIE | | | |
| Total Chili 2 228 0,85 | | | | 3,500 % éch. 25/02/2033 800 928 0,35 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| CHYPRE | | | | Obligation internationale du gouvernement français | | | | Ferrovie dello Stato Italiane SpA | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 0,500 % éch. 25/06/2044 850 589 0,22 | | | | 3,750 % éch. 14/04/2027 € 1 200 1 340 0,51 | | | |
| Atrium Finance PLC | | | | Régie Autonome des Transports Parisiens | | | | UniCredit SpA | | | |
| 2,625 % éch. 05/09/2027 € 1 100 948 0,36 | | | | 3,250 % éch. 11/04/2033 1 400 1 585 0,60 | | | | 5,850 % éch. 15/11/2027 2 200 2 576 0,98 | | | |
| RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | | Région d'Île de France | | | | 3 916 1,49 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,050 % éch. 03/02/2033 200 225 0,09 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S | | | | Société Du Grand Paris EPIC | | | | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 3,750 % éch. 20/06/2028 600 678 0,26 | | | | 0,300 % éch. 25/11/2031 1 900 1 735 0,66 | | | | 1,500 % éch. 30/04/2045 1 050 734 0,28 | | | |
| DANEMARK | | | | 1,000 % éch. 18/02/2070 100 49 0,02 | | | | 4,000 % éch. 30/10/2031 400 460 0,18 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,500 % éch. 25/05/2043 500 562 0,21 | | | | 1 194 0,46 | | | |
| AP Møller - Maersk A/S | | | | Société Nationale SNCF S.A. | | | | Total Italie 5 110 1,95 | | | |
| 5,875 % éch. 14/09/2033 \$ 1 000 1 044 0,40 | | | | 0,625 % éch. 17/04/2030 800 775 0,30 | | | | JAPON | | | |
| Danske Bank A/S | | | | 3,375 % éch. 25/05/2033 800 916 0,35 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 4,750 % éch. 21/06/2030 € 700 816 0,31 | | | | 8 452 3,22 | | | | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | | |
| TDC Net A/S | | | | Total France 17 218 6,56 | | | | 0,848 % éch. 19/07/2029 800 793 0,30 | | | |
| 5,618 % éch. 06/02/2030 1 900 2 170 0,83 | | | | ALLEMAGNE | | | | Norinchukin Bank | | | |
| Total Danemark 4 030 1,54 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,080 % éch. 22/09/2031 \$ 1 000 820 0,31 | | | |
| | | | | Amprion GmbH | | | | 4,867 % éch. 14/09/2027 600 600 0,23 | | | |
| | | | | 3,875 % éch. 07/09/2028 400 456 0,17 | | | | NTT Finance Corp. | | | |
| | | | | Commerzbank AG | | | | 0,399 % éch. 13/12/2028 € 1 300 1 278 0,49 | | | |
| | | | | 3,000 % éch. 14/09/2027 500 541 0,21 | | | | 4,239 % éch. 25/07/2025 \$ 2 900 2 870 1,09 | | | |
| | | | | 3,375 % éch. 12/12/2025 700 780 0,30 | | | | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | |
| | | | | 5,250 % éch. 25/03/2029 100 116 0,04 | | | | 2,472 % éch. 14/01/2029 1 300 1 158 0,44 | | | |
| | | | | Deutsche Bahn Finance GmbH | | | | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | |
| | | | | 3,250 % éch. 19/05/2033 600 685 0,26 | | | | 2,800 % éch. 10/03/2027 800 750 0,29 | | | |
| | | | | Deutsche Bank AG | | | | Total Japon 8 269 3,15 | | | |
| | | | | 1,875 % éch. 23/02/2028 1 900 1 975 0,75 | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | NATIONALE-NEDERLANDEN | | | | DESCRIPTIO | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Nationale-Nederlanden Bank NV | | | | 0,010 % éch. 23/06/2028 € 2 000 \$ 1 974 0,75 | | | |
| Aptiv PLC | | | | 0,500 % éch. 21/09/2028 € 1 100 \$ 1 074 0,41 | | | | 0,150 % éch. 10/10/2034 500 421 0,16 | | | |
| 3,100 % éch. 01/12/2051 \$ 200 \$ 131 0,05 | | | | 1,875 % éch. 17/05/2032 200 206 0,08 | | | | 3,125 % éch. 09/11/2031 800 915 0,35 | | | |
| LUXEMBOURG | | | | NE Property BV | | | | Banque européenne d'investissement | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,000 % éch. 20/01/2030 1 400 1 245 0,47 | | | | 0,750 % éch. 15/07/2027 AUD 500 304 0,12 | | | |
| Acef Holding S.C.A. | | | | TenneT Holding BV | | | | 1,500 % éch. 15/06/2032 € 5 600 5 704 2,17 | | | |
| 0,750 % éch. 14/06/2028 € 1 600 1 524 0,58 | | | | 4,500 % éch. 28/10/2034 700 864 0,33 | | | | 2,250 % éch. 15/03/2030 1 230 1 345 0,51 | | | |
| CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund | | | | VIA Outlets BV | | | | 3,750 % éch. 14/02/2033 \$ 5 000 4 906 1,87 | | | |
| 0,500 % éch. 27/01/2028 1 200 1 174 0,45 | | | | 1,750 % éch. 15/11/2028 1 100 1 082 0,41 | | | | Union européenne | | | |
| 0,900 % éch. 12/10/2029 1 000 920 0,35 | | | | Wabtec Transportation Netherlands BV | | | | 0,000 % éch. 04/10/2030 (a) € 1 400 1 314 0,50 | | | |
| CPI Property Group S.A. | | | | 1,250 % éch. 03/12/2027 1 900 1 938 0,74 | | | | 0,300 % éch. 04/11/2050 100 57 0,02 | | | |
| 1,750 % éch. 14/01/2030 100 63 0,02 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 0,400 % éch. 04/02/2037 800 654 0,25 | | | |
| 2,750 % éch. 22/01/2028 £ 400 359 0,14 | | | | Nederlandse Waterschapsbank NV | | | | 2,625 % éch. 04/02/2048 900 926 0,35 | | | |
| Prologis International Funding S.A. | | | | 3,250 % éch. 15/01/2044 300 369 0,14 | | | | 2,750 % éch. 04/02/2033 600 672 0,26 | | | |
| 0,750 % éch. 23/03/2033 € 475 402 0,15 | | | | Obligation internationale du gouvernement néerlandais | | | | Banque internationale pour la reconstruction et le développement | | | |
| 0,875 % éch. 09/07/2029 125 122 0,05 | | | | 3,250 % éch. 15/01/2044 300 369 0,14 | | | | 2,125 % éch. 03/03/2025 \$ 1 000 971 0,37 | | | |
| 1,625 % éch. 17/06/2032 1 425 1 326 0,51 | | | | Total Pays-Bas 20 117 7,67 | | | | Association internationale de développement | | | |
| 3,625 % éch. 07/03/2030 200 220 0,08 | | | | NORVÈGE | | | | 0,750 % éch. 21/09/2028 £ 1 450 1 618 0,62 | | | |
| Segro Capital SARL | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Total Supranationales 21 884 8,34 | | | |
| 0,500 % éch. 22/09/2031 1 000 870 0,33 | | | | SINGAPOUR | | | | SUÈDE | | | |
| SELP Finance SARL | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 0,875 % éch. 27/05/2029 1 500 1 414 0,54 | | | | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. | | | | Castellum AB | | | |
| Total Luxembourg 8 394 3,20 | | | | 4,250 % éch. 25/03/2027 \$ 630 576 0,22 | | | | 0,750 % éch. 04/09/2026 € 1 100 1 101 0,42 | | | |
| ÎLE MAURICE | | | | CORÉE DU SUD | | | | EQT AB | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 0,875 % éch. 14/05/2031 1 200 1 058 0,40 | | | |
| India Green Power Holdings | | | | LG Energy Solution Ltd. | | | | 2 159 0,82 | | | |
| 4,000 % éch. 22/02/2027 \$ 400 368 0,14 | | | | 5,750 % éch. 25/09/2028 300 310 0,12 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| MEXIQUE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Kommuninvest Sverige AB | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Korea Water Resources Corp. | | | | 3,125 % éch. 08/12/2027 500 568 0,22 | | | |
| Nemak S.A.B. de C.V. | | | | 3,500 % éch. 27/04/2025 700 686 0,26 | | | | 3,375 % éch. 15/03/2027 200 227 0,09 | | | |
| 2,250 % éch. 20/07/2028 € 1 000 983 0,37 | | | | Total Corée du Sud 996 0,38 | | | | Svensk Exportkredit AB | | | |
| MULTINATIONALES | | | | ESPAGNE | | | | 2,000 % éch. 30/06/2027 1 100 1 188 0,45 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 1 983 0,76 | | | |
| Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC | | | | Acciona Energia Financiacion Filiales S.A. | | | | Total Suède 4 142 1,58 | | | |
| 2,000 % éch. 01/09/2028 500 492 0,19 | | | | 5,125 % éch. 23/04/2031 € 400 467 0,18 | | | | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | |
| 3,000 % éch. 01/09/2029 150 134 0,05 | | | | Banco Santander S.A. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| NXP BV | | | | 0,625 % éch. 24/06/2029 900 881 0,34 | | | | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. | | | |
| 2,500 % éch. 11/05/2031 \$ 1 200 1 020 0,39 | | | | CaixaBank S.A. | | | | 4,875 % éch. 25/07/2033 \$ 600 596 0,23 | | | |
| Total Multinationales 1 646 0,63 | | | | 0,500 % éch. 09/02/2029 100 98 0,04 | | | | ROYAUME-UNI | | | |
| PAYS-BAS | | | | 1,500 % éch. 03/12/2026 £ 600 713 0,27 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,750 % éch. 07/09/2029 € 1 900 2 156 0,82 | | | | Assura Financing PLC | | | |
| ABN AMRO Bank NV | | | | Caja Rural de Navarra SCC | | | | 1,625 % éch. 30/06/2033 € 1 100 1 052 0,40 | | | |
| 2,470 % éch. 13/12/2029 2 400 2 114 0,81 | | | | 3,000 % éch. 26/04/2027 2 100 2 324 0,89 | | | | Berkeley Group PLC | | | |
| Arcadis NV | | | | EDP Servicios Financieros Espana S.A. | | | | 2,500 % éch. 11/08/2031 1 300 1 283 0,49 | | | |
| 4,875 % éch. 28/02/2028 € 400 458 0,17 | | | | 4,375 % éch. 04/04/2032 1 300 1 533 0,58 | | | | British Land Co. PLC | | | |
| ASR Nederland NV | | | | Telefonica Emisiones S.A. | | | | 2,375 % éch. 14/09/2029 1 400 1 543 0,59 | | | |
| 3,625 % éch. 12/12/2028 400 448 0,17 | | | | 4,183 % éch. 21/11/2033 500 581 0,22 | | | | Burberry Group PLC | | | |
| CTP NV | | | | 8 753 3,34 | | | | 1,125 % éch. 21/09/2025 600 717 0,27 | | | |
| 1,250 % éch. 21/06/2029 2 000 1 834 0,70 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Chanel Ceres PLC | | | |
| Digital Intrepid Holding BV | | | | Communauté autonome de Madrid | | | | 1,000 % éch. 31/07/2031 € 2 200 2 050 0,78 | | | |
| 0,625 % éch. 15/07/2031 1 500 1 303 0,50 | | | | 3,596 % éch. 30/04/2033 300 344 0,13 | | | | Compass Group PLC | | | |
| DSV Finance BV | | | | Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | | 4,375 % éch. 08/09/2032 £ 900 1 159 0,44 | | | |
| 0,500 % éch. 03/03/2031 500 463 0,18 | | | | 1,000 % éch. 30/07/2042 1 700 1 257 0,48 | | | | Derwent London PLC | | | |
| EnBW International Finance BV | | | | Xunta de Galicia | | | | 1,875 % éch. 17/11/2031 1 200 1 219 0,47 | | | |
| 4,300 % éch. 23/05/2034 300 351 0,13 | | | | 0,084 % éch. 30/07/2027 50 50 0,02 | | | | DS Smith PLC | | | |
| Enel Finance International NV | | | | 1 651 0,63 | | | | 4,375 % éch. 27/07/2027 € 400 455 0,17 | | | |
| 1,375 % éch. 12/07/2026 \$ 1 000 911 0,35 | | | | Total Espagne 10 404 3,97 | | | | Grainger PLC | | | |
| 7,500 % éch. 14/10/2032 500 571 0,22 | | | | SUPRANATIONALES | | | | 3,375 % éch. 24/04/2028 £ 700 824 0,31 | | | |
| ING Groep NV | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Land Securities Capital Markets PLC | | | |
| 1,125 % éch. 07/12/2028 £ 200 224 0,08 | | | | Eurofima Europäische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial | | | | 4,875 % éch. 15/09/2034 500 656 0,25 | | | |
| 4,875 % éch. 16/05/2029 (b)(c) \$ 1 000 830 0,32 | | | | 0,000 % éch. 28/07/2026 (a) 100 103 0,04 | | | | London & Quadrant Housing Trust | | | |
| JDE Peet's NV | | | | 28/07/2026 (a) 100 103 0,04 | | | | 2,000 % éch. 31/03/2032 400 416 0,16 | | | |
| 2,250 % éch. 24/09/2031 1 000 802 0,31 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Marks & Spencer PLC | | | |
| LeasePlan Corp. NV | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,500 % éch. 10/07/2027 300 370 0,14 | | | |
| 0,250 % éch. 07/09/2026 € 1 400 1 422 0,54 | | | | National Grid PLC | | | | 3,875 % éch. 16/01/2029 € 300 341 0,13 | | | |
| Lseg Netherlands BV | | | | NatWest Group PLC | | | | 2,057 % éch. 09/11/2028 £ 1 200 1 367 0,52 | | | |
| 4,231 % éch. 29/09/2030 500 584 0,22 | | | | 2,896 % éch. 15/03/2032 \$ 2 400 2 051 0,78 | | | | Santander UK Group Holdings PLC | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------------|-------|------|
| Severn Trent Utilities Finance PLC 2,625 % éch. 22/02/2033 | £ 600 | \$ 644 | 0,25 | Community Preservation Corp. 2,867 % éch. 01/02/2030 | \$ 360 | \$ 316 | 0,12 | Public Service Co. of Colorado 2,700 % éch. 15/01/2051 | \$ 75 | \$ 47 | 0,02 | | | |
| South Eastern Power Networks PLC 1,750 % éch. 30/09/2034 | 2 100 | 2 033 | 0,78 | Continental Wind LLC 6,000 % éch. 28/02/2033 | 518 | 528 | 0,20 | Public Service Electric & Gas Co. 3,200 % éch. 01/03/2050 | 425 | 306 | 0,12 | | | |
| SSE PLC 4,000 % éch. 05/09/2031 | € 600 | 694 | 0,26 | Crown Cork & Seal Co., Inc. 7,375 % éch. 15/12/2026 | 725 | 762 | 0,29 | Solar Star Funding LLC 5,375 % éch. 30/06/2035 | 933 | 927 | 0,35 | | | |
| Standard Chartered PLC 0,800 % éch. 17/11/2029 | 1 800 | 1 732 | 0,66 | Farmers Exchange Capital 5,454 % éch. 15/10/2054 | 30 | 25 | 0,01 | Southern California Edison Co. 2,500 % éch. 01/06/2031 | 1 000 | 858 | 0,33 | | | |
| Travis Perkins PLC 3,750 % éch. 17/02/2026 (e) | £ 1 100 | 1 324 | 0,51 | Ford Motor Co. 3,250 % éch. 12/02/2032 | 200 | 166 | 0,06 | Southwestern Public Service Co. 3,150 % éch. 01/05/2050 | 450 | 309 | 0,12 | | | |
| Vodafone Group PLC 5,125 % éch. 04/06/2081 | \$ 950 | 719 | 0,27 | Gap, Inc. 3,625 % éch. 01/10/2029 | 1 000 | 856 | 0,33 | TerraForm Power Operating LLC 5,000 % éch. 31/01/2028 | 650 | 632 | 0,24 | | | |
| Workspace Group PLC 2,250 % éch. 11/03/2028 | £ 400 | 438 | 0,17 | HAT Holdings LLC 6,000 % éch. 15/04/2025 | 500 | 499 | 0,19 | Topaz Solar Farms LLC 5,750 % éch. 30/09/2039 | 762 | 759 | 0,29 | | | |
| Zenith Finco PLC 6,500 % éch. 30/06/2027 (e) | 500 | 520 | 0,20 | Host Hotels & Resorts LP 3,375 % éch. 15/12/2029 | 600 | 539 | 0,20 | UDR, Inc. 3,100 % éch. 01/11/2034 | 150 | 124 | 0,05 | | | |
| | | 23 607 | 9,00 | 3,500 % éch. 15/09/2030 | 1 575 | 1 406 | 0,54 | Verizon Communications, Inc. 1,500 % éch. 18/09/2030 | 3 110 | 2 564 | 0,98 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Hudson Pacific Properties LP 3,950 % éch. 01/11/2027 | 500 | 419 | 0,16 | VF Corp. 4,250 % éch. 07/03/2029 | € 400 | 426 | 0,16 | | | |
| Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/07/2033 | 3 700 | 3 695 | 1,41 | Hyundai Capital America 5,800 % éch. 26/06/2025 | 1 700 | 1 710 | 0,65 | Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % éch. 01/04/2033 | \$ 600 | 602 | 0,23 | | | |
| 3,750 % éch. 22/10/2053 | 800 | 953 | 0,36 | IHG Finance LLC 4,375 % éch. 28/11/2029 | € 800 | 917 | 0,35 | Wisconsin Public Service Corp. 2,850 % éch. 01/12/2051 | 450 | 298 | 0,11 | | | |
| | | 4 648 | 1,77 | JPMorgan Chase & Co. 6,070 % éch. 22/10/2027 | \$ 1 300 | 1 338 | 0,51 | | | 41 932 | 15,99 | | | |
| Total Royaume-Uni | | 28 255 | 10,77 | Kilroy Realty LP 2,500 % éch. 15/11/2032 | 700 | 531 | 0,20 | OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX | | | | | | |
| ÉTATS-UNIS | | | | 2,650 % éch. 15/11/2033 | 100 | 76 | 0,03 | Obligations New York City Municipal Water Finance Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 5,724 % éch. 15/06/2042 | | | | 170 | 186 | 0,07 |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | MidAmerican Energy Co. 2,700 % éch. 01/08/2052 | 950 | 616 | 0,23 | Obligations New York City Municipal Water Finance Authority Revenue Bonds, Series 2010 5,882 % éch. 15/06/2044 | | | | 110 | 123 | 0,05 |
| GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2,100 % éch. 20/05/2048 | \$ 972 | 751 | 0,29 | Mississippi Power Co. 3,100 % éch. 30/07/2051 | 900 | 605 | 0,23 | Billets State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020 2,154 % éch. 01/07/2030 | | | | 170 | 145 | 0,05 |
| 4,000 % éch. 20/04/2049 | 969 | 853 | 0,33 | Moody's Corp. 2,000 % éch. 19/08/2031 | 300 | 249 | 0,09 | | | 454 | 0,17 | | | |
| 4,950 % éch. 20/07/2049 | 1 801 | 1 658 | 0,63 | 3,100 % éch. 29/11/2061 | 840 | 569 | 0,22 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | | | |
| 5,520 % éch. 22/02/2055 | 657 | 643 | 0,24 | MSCI, Inc. 3,250 % éch. 15/08/2033 | 200 | 167 | 0,06 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/10/2053 | | | | 6 371 | 6 304 | 2,40 |
| Loanpal Solar Loan Ltd. 2,220 % éch. 20/03/2048 | 561 | 419 | 0,16 | 4,000 % éch. 15/11/2029 | 100 | 94 | 0,03 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | | | |
| | | 4 324 | 1,65 | New York State Electric & Gas Corp. 2,150 % éch. 01/10/2031 | 1 100 | 877 | 0,33 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/07/2028 | | | | 1 200 | 1 213 | 0,46 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,650 % éch. 15/08/2028 | 2 300 | 2 360 | 0,90 | Total États-Unis | | | | 54 227 | 20,67 | |
| AES Corp. 2,450 % éch. 15/01/2031 | 300 | 252 | 0,10 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % éch. 15/06/2028 | 2 100 | 1 865 | 0,71 | ÎLES VIERGES BRITANNIQUES | | | | | | |
| 5,450 % éch. 01/06/2028 | 700 | 712 | 0,27 | Northern States Power Co. 2,250 % éch. 01/04/2031 | 600 | 515 | 0,20 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,000 % éch. 18/05/2032 | 1 100 | 883 | 0,34 | NSTAR Electric Co. 3,100 % éch. 01/06/2051 | 1 070 | 755 | 0,29 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % éch. 24/04/2033 | | | | 811 | 811 | 0,31 |
| Amgen, Inc. 3,000 % éch. 22/02/2029 | 1 300 | 1 224 | 0,47 | Oberlin College 2,874 % éch. 01/10/2051 | 1 800 | 1 180 | 0,45 | Total des Valeurs mobilières | | | | \$ 249 832 | 95,24 | |
| Autodesk, Inc. 2,400 % éch. 15/12/2031 | 1 000 | 856 | 0,33 | Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % éch. 01/04/2053 | 400 | 435 | 0,16 | | | | | | | |
| Bank of America Corp. 2,456 % éch. 22/10/2025 | 1 100 | 1 071 | 0,41 | PacifiCorp 2,900 % éch. 15/06/2052 | 600 | 387 | 0,15 | | | | | | | |
| 4,134 % éch. 12/06/2028 | € 1 400 | 1 596 | 0,61 | | | | | | | | | | | |
| 6,204 % éch. 10/11/2028 | \$ 500 | 522 | 0,20 | | | | | | | | | | | |
| Boston Properties LP 2,450 % éch. 01/10/2033 | 1 020 | 777 | 0,30 | | | | | | | | | | | |
| 6,500 % éch. 15/01/2034 | 150 | 158 | 0,06 | | | | | | | | | | | |
| CBRE Services, Inc. 2,500 % éch. 01/04/2031 | 1 370 | 1 160 | 0,44 | | | | | | | | | | | |
| CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % éch. 01/04/2053 | 600 | 629 | 0,24 | | | | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---|---------------------|---|---|------------------------|
| BOS | 5,420 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 5 800 | Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 28/02/2030 | \$ (5 930) | \$ 5 800 | \$ 5 803 | 2,21 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (5 930) | \$ 5 800 | \$ 5 803 | 2,21 |

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 256 | \$ (1 173) | (0,45) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 29 | (367) | (0,14) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 16 | (33) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 495 | 1 318 | 0,50 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 186 | 767 | 0,29 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 102 | 565 | 0,22 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 70 | (793) | (0,30) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 74 | (597) | (0,23) |
| | | | | \$ (313) | (0,12) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (313) | (0,12) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 600 | \$ (100) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2027 | \$ 6 400 | (153) | (0,06) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,840 | 08/07/2051 | 100 | 33 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,943 | 15/06/2051 | 400 | 122 | 0,05 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,000 | 16/06/2026 | CAD 900 | (34) | (0,01) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 1 800 | (205) | (0,08) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 6 300 | 252 | 0,10 |
| | | | | | \$ (85) | (0,03) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (85) | (0,03) |

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 947 | \$ 1 202 | \$ 0 | \$ (5) | \$ (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 623 | ¥ 91 882 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| | 01/2024 | 29 | SEK 304 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 3 505 | \$ 3 817 | 0 | (56) | (56) | (0,02) |
| | 01/2024 | £ 3 125 | \$ 3 963 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 208 | € 190 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 603 | ¥ 88 800 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | € 44 719 | \$ 49 181 | 0 | (229) | (229) | (0,09) |
| | 01/2024 | \$ 510 | € 465 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 309 | \$ 392 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD 8 351 | \$ 6 145 | 0 | (189) | (189) | (0,07) |
| MBC | 01/2024 | € 576 | \$ 630 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 26 | \$ 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD 26 | \$ 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 20 | € 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 280 | £ 219 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | CHF 563 | \$ 654 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| SCX | 01/2024 | £ 13 537 | \$ 17 122 | 0 | (135) | (135) | (0,05) |
| UAG | 01/2024 | € 70 359 | \$ 77 393 | 0 | (348) | (348) | (0,13) |
| | 01/2024 | £ 3 463 | \$ 4 379 | 0 | (35) | (35) | (0,01) |
| | | | | \$ 63 | \$ (1 040) | \$ (977) | (0,37) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 683 | AUD 1 025 | \$ 17 | \$ 0 | \$ 17 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | AUD 324 | \$ 213 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 254 | AUD 386 | \$ 9 | \$ 0 | \$ 9 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 61 | 92 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 525 | 792 | 15 | 0 | 15 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | 115 | 170 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 44 | \$ (8) | \$ 36 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 4 | \$ 5 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | \$ 35 | CHF 31 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 6 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 299 | 262 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 303 | 264 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 274 | 239 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | | | | \$ 35 | \$ 0 | \$ 35 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 027 | \$ 1 123 | \$ 0 | \$ (12) | \$ (12) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 5 651 | € 5 178 | 71 | 0 | 71 | 0,03 |
| BRC | 01/2024 | 44 023 | 40 029 | 205 | 0 | 205 | 0,08 |
| CBK | 01/2024 | € 579 | \$ 638 | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 101 | € 94 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 272 | \$ 294 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 18 | € 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 47 043 | 42 800 | 249 | 0 | 249 | 0,09 |
| UAG | 01/2024 | 47 079 | 42 800 | 212 | 0 | 212 | 0,08 |
| | | | | \$ 740 | \$ (21) | \$ 719 | 0,27 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 24 | \$ 31 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 825 | £ 3 809 | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | 4 487 | 3 538 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 78 | 62 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 68 | \$ 86 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 41 | £ 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | £ 6 | \$ 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 270 | 344 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 56 | £ 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 2 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 69 | £ 54 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 25 778 | 20 380 | 204 | 0 | 204 | 0,08 |
| SSB | 01/2024 | £ 20 | \$ 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 16 845 | £ 13 349 | 173 | 0 | 173 | 0,07 |
| UAG | 01/2024 | £ 9 | \$ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 25 774 | £ 20 366 | 189 | 0 | 189 | 0,07 |
| | | | | \$ 620 | \$ (3) | \$ 617 | 0,24 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | SEK 6 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 548 | SEK 5 718 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 1 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | SEK 81 | \$ 8 | 0 | 0 | 0 | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 73 | SEK 755 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SEK 4 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 | SEK 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SEK 26 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 | SEK 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | SEK 14 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 575 | SEK 5 968 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | SEK 38 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 590 | SEK 6 084 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | | | | \$ 53 | \$ 0 | \$ 53 | 0,02 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 1 311 | SGD 1 749 | \$ 15 | \$ 0 | \$ 15 | 0,01 |
| BOA | 01/2024 | 1 361 | 1 816 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | SGD 6 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 145 | SGD 194 | 2 | 0 | 2 | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | SGD 12 | \$ 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 17 | SGD 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 24 | 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 1 254 | 1 673 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 02/2024 | 3 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 4 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 47 | \$ 0 | \$ 47 | 0,02 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ 530 | 0,20 |
| Total des Investissements | | | | | | \$ 255 764 | 97,50 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | \$ 6 552 | 2,50 |
| Actifs nets | | | | | | \$ 262 316 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
- (b) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (c) Titre convertible conditionnel.
- (d) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------------|---------|-----------------|--------------|--------|--------------|---------------------|
| Brookfield Property Finance ULC | 7,125 % | 13/02/2028 | 09/02/2023 | \$ 522 | \$ 522 | 0,20 |

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 623 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 3 138 \$ (31 décembre 2022 : 3 781 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 50 \$ (31 décembre 2022 : 4 260 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | | Autres données significatives observables (Niveau 2) | | Données significatives non observables (Niveau 3) | | Juste valeur |
|---|---|--|--|--|---|--|-------------------|
| | | | | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 0 | | \$ 249 832 | | \$ 0 | | \$ 249 832 |
| Contrats de mise en pension | 0 | | 5 800 | | 0 | | 5 800 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (2 137) | | 2 269 | | 0 | | 132 |
| Totaux | \$ (2 137) | | \$ 257 901 | | \$ 0 | | \$ 255 764 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | | Autres données significatives observables (Niveau 2) | | Données significatives non observables (Niveau 3) | | Juste valeur |
|---|---|--|--|--|---|--|-------------------|
| | | | | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 0 | | \$ 248 281 | | \$ 0 | | \$ 248 281 |
| Contrats de mise en pension | 0 | | 36 800 | | 0 | | 36 800 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 2 683 | | (46) | | 0 | | 2 637 |
| Totaux | \$ 2 683 | | \$ 285 035 | | \$ 0 | | \$ 287 718 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| JML | 1,00 % | 14/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | £ (250) | \$ (320) | (0,12) |
| | 4,100 | 14/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (377) | (483) | (0,19) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (803) | (0,31) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 32 | \$ 0 | \$ 32 | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | 90 | 0 | 90 | (522) | 560 | 38 |
| BPS | 35 | 0 | 35 | (3 021) | 2 670 | (351) |
| BRC | (17) | 50 | 33 | (6) | 40 | 34 |
| CBK | (2) | 0 | (2) | 1 594 | (1 510) | 84 |
| DUB | S/O | S/O | S/O | (1 016) | 990 | (26) |
| GLM | (172) | 0 | (172) | 42 | (110) | (68) |
| JPM | S/O | S/O | S/O | 16 | 0 | 16 |
| MBC | 2 | 0 | 2 | 1 318 | (1 270) | 48 |
| MYI | 274 | (540) | (266) | 43 | (20) | 23 |
| RBC | S/O | S/O | S/O | 0 | 0 | 0 |
| RYL | (15) | 0 | (15) | (113) | 0 | (113) |
| SCX | 88 | 0 | 88 | 1 674 | (1 560) | 114 |
| SSB | 173 | 0 | 173 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 42 | 0 | 42 | 86 | 0 | 86 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû/de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 82,55 | 73,76 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 12,69 | 11,04 |
| Contrats de mise en pension | 2,21 | 0,04 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,12) | 12,57 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,03) | 0,81 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,20 | 0,06 |
| Contrats de prise en pension | (0,31) | 0,03 |

*Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Australie | 0,37 | 0,31 |
| Autriche | 0,51 | 0,21 |
| Belgique | 0,50 | 0,40 |
| Brésil | 0,08 | 0,07 |
| Canada | 1,97 | 1,62 |
| Chili | 0,85 | 0,70 |
| Chypre | 0,36 | 0,28 |
| République tchèque | 0,26 | S/O |
| Danemark | 1,54 | S/O |
| Finlande | 1,39 | 0,28 |
| France | 6,56 | 6,29 |
| Allemagne | 13,86 | 11,61 |
| Inde | 0,95 | 1,30 |
| Irlande | 2,23 | 1,49 |
| Italie | 1,95 | 1,97 |
| Japon | 3,15 | 3,29 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,05 | 0,36 |
| Luxembourg | 3,20 | 2,89 |
| Île Maurice | 0,14 | 0,97 |
| Mexique | 0,37 | 0,29 |
| Multinationales | 0,63 | 0,87 |
| Pays-Bas | 7,67 | 8,65 |
| Norvège | 0,18 | S/O |
| Singapour | 0,22 | 0,20 |
| Corée du Sud | 0,38 | 0,31 |
| Espagne | 3,97 | 2,01 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Supranationales | 8,34 | 4,97 |
| Suède | 1,58 | 1,20 |
| Suisse | S/O | 0,30 |
| Émirats arabes unis | 0,23 | S/O |
| Royaume-Uni | 10,77 | 8,79 |
| États-Unis | 20,67 | 21,97 |
| Îles Vierges britanniques | 0,31 | 0,26 |
| Instruments à court terme | S/O | 0,98 |
| Contrats de mise en pension | 2,21 | 12,57 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,12) | 0,81 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,03) | 0,06 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Contrats de change à terme | (0,37) | (1,53) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,57 | 1,56 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 2,50 | 1,69 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | |
| AUSTRALIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement australien | | | |
| 0,250 % éch. 21/11/2032 AUD | 5 612 | \$ 3 456 | 0,40 |
| 0,750 % éch. 21/11/2027 | 4 276 | 2 884 | 0,34 |
| 3,000 % éch. 20/09/2025 | 1 763 | 1 238 | 0,14 |
| Total Australie | | 7 578 | 0,88 |
| CANADA | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien | | | |
| 0,500 % éch. 01/12/2050 (c) | CAD 244 | 148 | 0,02 |
| 4,250 % éch. 01/12/2026 (c) | 2 889 | 2 377 | 0,27 |
| Total Canada | | 2 525 | 0,29 |
| ÎLES CAÏMANS | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Allegro CLO Ltd. | | | |
| 6,820 % éch. 16/10/2031 | \$ 500 | 501 | 0,06 |
| Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | |
| 6,745 % éch. 15/01/2031 | 4 786 | 4 793 | 0,56 |
| 6,805 % éch. 16/01/2030 | 584 | 584 | 0,07 |
| BlueMountain CLO Ltd. | | | |
| 6,854 % éch. 22/10/2030 | 1 347 | 1 347 | 0,16 |
| Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. | | | |
| 6,655 % éch. 15/01/2031 | 545 | 545 | 0,06 |
| Catamaran CLO Ltd. | | | |
| 6,774 % éch. 22/04/2030 | 1 890 | 1 890 | 0,22 |
| Cedar Funding CLO Ltd. | | | |
| 6,764 % éch. 17/07/2031 | 700 | 700 | 0,08 |
| CIFC Funding Ltd. | | | |
| 6,709 % éch. 27/04/2031 | 1 190 | 1 190 | 0,14 |
| Dryden CLO Ltd. | | | |
| 6,651 % éch. 15/05/2031 | 676 | 676 | 0,08 |
| Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. | | | |
| 6,656 % éch. 15/09/2037 | 611 | 610 | 0,07 |
| ICG U.S. CLO Ltd. | | | |
| 6,754 % éch. 22/07/2031 | 2 318 | 2 319 | 0,27 |
| LCM LP | | | |
| 6,717 % éch. 20/07/2031 | 2 888 | 2 884 | 0,34 |
| 6,785 % éch. 15/10/2031 | 1 200 | 1 199 | 0,14 |
| Madison Park Funding Ltd. | | | |
| 0,000 % éch. 29/07/2030 | 386 | 386 | 0,04 |
| Magnétite Ltd. | | | |
| 6,635 % éch. 15/04/2031 | 279 | 278 | 0,03 |
| Octagon Investment Partners Ltd. | | | |
| 6,615 % éch. 16/04/2031 | 3 300 | 3 298 | 0,38 |
| Octagon Loan Funding Ltd. | | | |
| 6,809 % éch. 18/11/2031 | 2 500 | 2 503 | 0,29 |
| OZLM Ltd. | | | |
| 6,744 % éch. 17/04/2031 | 2 559 | 2 558 | 0,30 |
| 6,827 % éch. 20/01/2031 | 2 728 | 2 731 | 0,32 |
| Regatta Funding Ltd. | | | |
| 6,914 % éch. 17/10/2030 | 3 260 | 3 258 | 0,38 |
| Sound Point CLO Ltd. | | | |
| 6,741 % éch. 26/07/2031 | 1 489 | 1 488 | 0,17 |
| 6,797 % éch. 21/01/2031 | 1 203 | 1 202 | 0,14 |
| 6,807 % éch. 18/04/2031 | 2 200 | 2 198 | 0,26 |
| TIAA CLO Ltd. | | | |
| 6,877 % éch. 20/07/2031 | 478 | 478 | 0,06 |
| Voya CLO Ltd. | | | |
| 6,755 % éch. 14/07/2031 | 472 | 472 | 0,05 |
| 6,865 % éch. 15/10/2030 | 1 573 | 1 571 | 0,18 |
| | | 41 659 | 4,85 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. | | | |
| 2,528 % éch. 18/11/2027 | 258 | 229 | 0,03 |
| Total Îles Caïmans | | 41 888 | 4,88 |
| DANEMARK | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Jyske Realkredit A/S | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 DKK | 542 | 63 | 0,01 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|
| 1,000 % éch. 01/10/2053 DKK | | | |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 6 864 | 815 | 0,10 |
| 2,000 % éch. 01/10/2053 | 2 773 | 339 | 0,04 |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 | 1 | 0 | 0,00 |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab | | | |
| 0,500 % éch. 01/10/2043 | 6 448 | 777 | 0,09 |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 3 899 | 430 | 0,05 |
| 2,000 % éch. 01/10/2053 | 999 | 122 | 0,01 |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 | 3 | 0 | 0,00 |
| Nykredit Realkredit A/S | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 1 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 10 | 1 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 6 029 | 721 | 0,08 |
| 2,000 % éch. 01/10/2053 | 6 065 | 702 | 0,08 |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 | 12 | 2 | 0,00 |
| 3,500 % éch. 01/10/2053 | 14 334 | 2 058 | 0,25 |
| Realkredit Danmark A/S | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 13 621 | 1 580 | 0,18 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 5 218 | 575 | 0,07 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 17 576 | 2 077 | 0,24 |
| 2,000 % éch. 01/10/2053 | 3 914 | 442 | 0,05 |
| 2,500 % éch. 01/04/2047 | 12 | 2 | 0,00 |
| Total Danemark | | 11 385 | 1,33 |
| FRANCE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement français | | | |
| 0,100 % éch. 01/03/2025 (c) | € 20 124 | 21 914 | 2,55 |
| 0,100 % éch. 25/07/2031 (c) | 9 818 | 10 695 | 1,25 |
| 0,100 % éch. 25/07/2038 (c) | 7 085 | 7 337 | 0,85 |
| Total France | | 39 946 | 4,65 |
| IRLANDE | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Ares European CLO DAC | | | |
| 4,575 % éch. 15/04/2030 | 671 | 735 | 0,09 |
| 4,625 % éch. 15/10/2030 | 1 329 | 1 458 | 0,17 |
| 4,843 % éch. 20/04/2032 | 2 100 | 2 283 | 0,27 |
| Armada Euro CLO DAC | | | |
| 4,685 % éch. 15/07/2031 | 497 | 544 | 0,06 |
| Bain Capital Euro CLO DAC | | | |
| 5,102 % éch. 24/01/2033 | 1 300 | 1 425 | 0,17 |
| Black Diamond CLO DAC | | | |
| 4,853 % éch. 20/01/2032 | 1 421 | 1 561 | 0,18 |
| 4,982 % éch. 15/05/2032 | 2 540 | 2 771 | 0,32 |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | |
| 1,050 % éch. 15/01/2031 | 993 | 1 039 | 0,12 |
| 4,685 % éch. 15/01/2031 | 2 086 | 2 279 | 0,27 |
| BNPP AM Euro CLO DAC | | | |
| 4,565 % éch. 15/04/2031 | 1 600 | 1 741 | 0,20 |
| Cairn CLO DAC | | | |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | 2 298 | 2 498 | 0,29 |
| Carlyle Euro CLO DAC | | | |
| 4,665 % éch. 15/01/2031 | 2 182 | 2 386 | 0,28 |
| 4,892 % éch. 15/08/2032 | 900 | 981 | 0,11 |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | |
| 4,852 % éch. 26/08/2032 | 500 | 546 | 0,06 |
| Dryden Euro CLO DAC | | | |
| 4,752 % éch. 15/05/2032 | 1 278 | 1 392 | 0,16 |
| 4,862 % éch. 15/05/2034 | 2 396 | 2 606 | 0,30 |
| Harvest CLO DAC | | | |
| 1,040 % éch. 15/07/2031 | 700 | 732 | 0,09 |
| 4,566 % éch. 26/06/2030 | 1 059 | 1 157 | 0,13 |
| 4,725 % éch. 15/07/2031 | 1 400 | 1 524 | 0,18 |
| Invesco Euro CLO DAC | | | |
| 4,885 % éch. 15/07/2032 | 2 600 | 2 831 | 0,33 |
| Laurelin DAC | | | |
| 4,713 % éch. 20/10/2031 | 1 140 | 1 247 | 0,15 |
| Madison Park Euro Funding DAC | | | |
| 4,765 % éch. 15/07/2032 | 700 | 763 | 0,09 |
| Man GLG Euro CLO DAC | | | |
| 4,835 % éch. 15/01/2030 | 66 | 72 | 0,01 |
| Oak Hill European Credit Partners DAC | | | |
| 4,733 % éch. 20/10/2031 | 1 097 | 1 199 | 0,14 |
| OCP Euro CLO DAC | | | |
| 4,882 % éch. 22/09/2034 | 2 600 | 2 831 | 0,33 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 782 | \$ 850 | 0,10 |
| Rockford Tower Europe CLO DAC | | | |
| 4,968 % éch. 20/12/2031 | 2 344 | 2 569 | 0,30 |
| Segovia European CLO DAC | | | |
| 4,873 % éch. 20/07/2032 | 2 300 | 2 508 | 0,29 |
| Tikehau CLO DAC | | | |
| 4,844 % éch. 04/08/2034 | 2 600 | 2 839 | 0,33 |
| Toro European CLO DAC | | | |
| 4,812 % éch. 15/02/2034 | 3 700 | 4 032 | 0,47 |
| | | 51 399 | 5,99 |

| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
|--|-----|--------|------|
| European Loan Conduit DAC | | | |
| 4,994 % éch. 17/02/2030 | 573 | 625 | 0,07 |
| Total Irlande | | 52 024 | 6,06 |

| ITALIE | | | |
|-----------------------------------|--------|--------|-------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 0,400 % éch. 15/05/2030 (c) | 18 710 | 19 321 | 2,25 |
| 1,400 % éch. 26/05/2025 (c) | 33 682 | 36 622 | 4,26 |
| 2,350 % éch. 15/09/2024 (c) | 26 590 | 29 443 | 3,43 |
| 2,550 % éch. 15/09/2041 (c) | 1 481 | 1 753 | 0,21 |
| Total Italie | | 87 139 | 10,15 |

| JAPON | | | |
|--|-----------|--------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement japonais | | | |
| 0,100 % éch. 10/09/2024 (c) | ¥ 953 040 | 6 865 | 0,80 |
| 0,100 % éch. 10/03/2025 (c) | 1 036 175 | 7 533 | 0,88 |
| 0,100 % éch. 10/03/2026 (c) | 784 983 | 5 788 | 0,67 |
| 0,100 % éch. 10/03/2028 (c) | 1 357 864 | 10 123 | 1,18 |
| 0,100 % éch. 10/03/2029 (c) | 4 796 771 | 35 845 | 4,17 |
| Total Japon | | 66 154 | 7,70 |

| NOUVELLE-ZÉLANDE | | | |
|---|-------|-------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais | | | |
| 2,000 % éch. 20/09/2025 NZD | 3 229 | 2 038 | 0,24 |

| PÉROU | | | |
|--|-----|-----|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | |
| 5,940 % éch. 12/02/2029 PEN | 400 | 108 | 0,01 |

| ESPAGNE | | | |
|--|---------|--------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | |
| 0,500 % éch. 30/04/2030 | € 2 500 | 2 419 | 0,28 |
| 0,650 % éch. 30/11/2027 (c) | 27 174 | 29 951 | 3,49 |
| 0,700 % éch. 30/11/2033 (c) | 1 339 | 1 431 | 0,17 |
| Total Espagne | | 33 801 | 3,94 |

| SUÈDE | | | |
|---|---------|--------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement suédois | | | |
| 0,125 % éch. 01/06/2026 SEK | 3 129 | 304 | 0,04 |
| 0,125 % éch. 01/12/2027 | 16 331 | 1 583 | 0,18 |
| 1,000 % éch. 01/06/2025 | 127 059 | 12 522 | 1,46 |
| Total Suède | | 14 409 | 1,68 |

| SUISSE | | | |
|--------------------------------------|--------|-------|------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| UBS Group AG | | | |
| 2,593 % éch. 11/09/2025 | \$ 600 | 587 | 0,07 |
| 4,965 % éch. 16/01/2026 | € 400 | 443 | 0,05 |
| Total Suisse | | 1 030 | 0,12 |

| ROYAUME-UNI | | | |
|--|-----|---|------|
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Great Hall Mortgages PLC | | | |
| 5,469 % éch. 18/03/2039 | £ 3 | 4 | 0,00 |
| 5,489 % éch. 18/06/2038 | 2 | 3 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Polaris PLC 5,995 % éch. 23/10/2059 | £ 2 696 | \$ 3 420 | 0,40 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | 684 | 873 | 0,10 |
| | | 4 300 | 0,50 |
| ACTIONS | | | |
| TITRES PRIVILÉGIÉS | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 1 606 | 267 | 0,03 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2024 (c) | £ 17 783 | 22 466 | 2,61 |
| 0,125 % éch. 22/03/2026 (c) | 177 | 225 | 0,03 |
| 0,125 % éch. 10/08/2028 (c) | 4 533 | 5 851 | 0,68 |
| 1,250 % éch. 22/11/2027 (c) | 22 194 | 29 856 | 3,48 |
| 2,500 % éch. 17/07/2024 | 24 593 | 31 090 | 3,62 |
| | | 89 488 | 10,42 |
| Total Royaume-Uni | | 94 055 | 10,95 |
| ÉTATS-UNIS | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,520 % éch. 25/12/2033 | \$ 742 | 734 | 0,09 |
| Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,430 % éch. 25/10/2035 | 1 300 | 1 191 | 0,14 |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust 5,610 % éch. 25/10/2036 | 2 125 | 1 965 | 0,23 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust 5,760 % éch. 25/09/2036 | 419 | 401 | 0,05 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass- Through Certificates 6,415 % éch. 25/10/2034 | 263 | 252 | 0,03 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 6,160 % éch. 25/10/2035 | 800 | 716 | 0,08 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 6,430 % éch. 25/02/2036 | 1 542 | 1 485 | 0,17 |
| Ellington Loan Acquisition Trust 6,570 % éch. 25/05/2037 | 563 | 543 | 0,06 |
| First Franklin Mortgage Loan Trust 5,780 % éch. 25/07/2036 | 143 | 137 | 0,02 |
| Home Equity Asset Trust 6,325 % éch. 25/08/2034 | 88 | 87 | 0,01 |
| 6,490 % éch. 25/03/2035 | 1 465 | 1 401 | 0,16 |
| Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,610 % éch. 25/11/2036 | 624 | 570 | 0,07 |
| Lehman XS Trust 7,770 % éch. 25/12/2037 | 766 | 731 | 0,08 |
| Mid-State Capital Corp. Trust 5,787 % éch. 15/10/2040 | 72 | 71 | 0,01 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 6,130 % éch. 25/01/2035 | 298 | 287 | 0,03 |
| 6,445 % éch. 25/07/2034 | 135 | 135 | 0,02 |
| New Century Home Equity Loan Trust 6,235 % éch. 25/02/2035 | 450 | 435 | 0,05 |
| Option One Mortgage Loan Trust 6,010 % éch. 25/01/2036 | 1 700 | 1 548 | 0,18 |
| Renaissance Home Equity Loan Trust 6,670 % éch. 25/11/2034 | 153 | 133 | 0,02 |
| Saxon Asset Securities Trust 5,780 % éch. 25/09/2037 | 223 | 210 | 0,02 |
| 5,905 % éch. 25/09/2036 | 3 000 | 2 821 | 0,33 |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 6,190 % éch. 25/10/2035 | 1 495 | 1 235 | 0,14 |
| | | 17 088 | 1,99 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Broadcom, Inc. 3,137 % éch. 15/11/2035 | 1 459 | 1 198 | 0,14 |
| Lehman Brothers Holdings, Inc. 7,875 % éch. 08/05/2018 ^ | £ 100 | 1 | 0,00 |
| | | 1 199 | 0,14 |
| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
| OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX | | | |
| Obligations American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010 7,734 % éch. 15/02/2033 | \$ 200 | \$ 236 | 0,03 |
| Obligations Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 6,918 % éch. 01/04/2040 | 600 | 702 | 0,08 |
| Obligations California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009 7,300 % éch. 01/10/2039 | 500 | 606 | 0,07 |
| 7,500 % éch. 01/04/2034 | 100 | 122 | 0,02 |
| 7,550 % éch. 01/04/2039 | 200 | 253 | 0,03 |
| Obligations Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010 5,516 % éch. 01/07/2027 | 500 | 516 | 0,06 |
| Obligations New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 5,508 % éch. 01/08/2037 | 200 | 206 | 0,02 |
| Obligations New York State Urban Development Corp. Revenue Bonds, (BABs), Series 2009 5,770 % éch. 15/03/2039 | 100 | 103 | 0,01 |
| | | 2 744 | 0,32 |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Banc of America Funding Trust 6,496 % éch. 20/09/2034 | 3 | 3 | 0,00 |
| BCAP LLC Trust 5,250 % éch. 26/04/2037 | 186 | 106 | 0,01 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,877 % éch. 25/05/2047 | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,974 % éch. 25/09/2034 | 43 | 40 | 0,00 |
| 4,924 % éch. 25/01/2035 | 20 | 19 | 0,00 |
| 5,224 % éch. 25/11/2034 | 4 | 3 | 0,00 |
| 5,453 % éch. 25/02/2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| Bear Stearns ALT-A Trust 4,235 % éch. 25/08/2036 | 12 | 6 | 0,00 |
| 5,044 % éch. 25/10/2033 | 0 | 0 | 0,00 |
| Chase Mortgage Finance Trust 4,114 % éch. 25/03/2037 | 4 | 4 | 0,00 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 6,277 % éch. 25/09/2035 | 1 | 1 | 0,00 |
| Countrywide Alternative Loan Trust 4,174 % éch. 25/02/2037 | 5 | 5 | 0,00 |
| 5,682 % éch. 20/07/2046 | 8 | 6 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/09/2046 | 7 | 7 | 0,00 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,430 % éch. 25/09/2047 | 5 | 4 | 0,00 |
| 6,110 % éch. 25/03/2035 | 62 | 57 | 0,01 |
| 6,230 % éch. 25/09/2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| Greenpoint Mortgage Funding Trust 5,910 % éch. 25/06/2045 | 58 | 54 | 0,01 |
| GSR Mortgage Loan Trust 4,381 % éch. 25/06/2034 | 3 | 3 | 0,00 |
| 4,649 % éch. 25/07/2035 | 30 | 27 | 0,00 |
| 4,836 % éch. 25/09/2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| HarborView Mortgage Loan Trust 6,372 % éch. 20/06/2035 | 173 | 156 | 0,02 |
| Impac CMB Trust 6,370 % éch. 25/10/2033 | 1 | 1 | 0,00 |
| IndyMac Mortgage Loan Trust 5,950 % éch. 25/07/2035 | 1 237 | 1 125 | 0,13 |
| 6,110 % éch. 25/07/2045 | 3 | 2 | 0,00 |
| JPMorgan Mortgage Trust 4,916 % éch. 25/04/2035 | 17 | 16 | 0,00 |
| 5,822 % éch. 25/08/2035 | 6 | 6 | 0,00 |
| Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass- Through Trust 5,916 % éch. 15/12/2030 | 1 | 1 | 0,00 |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 6,160 % éch. 25/08/2036 | 3 211 | 3 144 | 0,37 |
| New Residential Mortgage Loan Trust 4,500 % éch. 25/05/2058 | 398 | 385 | 0,05 |
| Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates 7,270 % éch. 25/04/2035 | 500 | 481 | 0,06 |
| Regal Trust 1,723 % éch. 29/09/2031 | 6 | 5 | 0,00 |
| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust | | | |
| 6,500 % éch. 25/03/2032 | \$ 6 | \$ 6 | 0,00 |
| Sequoia Mortgage Trust 5,872 % éch. 20/07/2036 | 406 | 353 | 0,04 |
| 6,164 % éch. 20/04/2035 | 13 | 12 | 0,00 |
| 6,170 % éch. 19/10/2026 | 2 | 2 | 0,00 |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust 6,050 % éch. 19/07/2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| 6,130 % éch. 19/10/2034 | 7 | 7 | 0,00 |
| 6,170 % éch. 19/03/2034 | 6 | 5 | 0,00 |
| Towd Point Mortgage Trust 2,750 % éch. 25/10/2056 | 87 | 87 | 0,01 |
| 3,250 % éch. 25/03/2058 | 448 | 435 | 0,05 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 6,090 % éch. 25/01/2045 | 9 | 9 | 0,00 |
| 6,210 % éch. 25/01/2045 | 49 | 48 | 0,01 |
| 6,250 % éch. 25/10/2044 | 147 | 139 | 0,02 |
| 6,412 % éch. 25/06/2042 | 1 | 1 | 0,00 |
| | | 6 786 | 0,79 |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Fannie Mae 5,188 % éch. 01/11/2034 | 151 | 150 | 0,02 |
| 6,000 % éch. 25/02/2044 | 4 | 4 | 0,00 |
| 6,022 % éch. 25/09/2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| 6,500 % éch. 25/06/2028 | 3 | 3 | 0,00 |
| Freddie Mac 5,000 % éch. 15/01/2035 | 139 | 138 | 0,02 |
| 5,732 % éch. 25/09/2031 | 7 | 7 | 0,00 |
| 5,903 % éch. 15/12/2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,934 % éch. 01/01/2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,953 % éch. 15/04/2028 | 2 | 2 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 15/04/2036 | 2 | 3 | 0,00 |
| 6,053 % éch. 15/03/2024 | 0 | 0 | 0,00 |
| 6,103 % éch. 15/03/2032 | 40 | 40 | 0,01 |
| Ginnie Mae 5,722 % éch. 20/02/2035 | 22 | 22 | 0,00 |
| 5,757 % éch. 20/10/2043 | 374 | 354 | 0,04 |
| 5,962 % éch. 20/02/2038 | 12 | 12 | 0,00 |
| 6,012 % éch. 20/03/2060 | 11 | 11 | 0,00 |
| 6,180 % éch. 20/08/2062 | 486 | 483 | 0,06 |
| 6,246 % éch. 20/08/2068 | 499 | 489 | 0,06 |
| 6,261 % éch. 20/07/2062 | 263 | 263 | 0,03 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | |
| 4,500 % éch. 01/09/2052 | 984 | 955 | 0,11 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 4,000 % éch. 01/02/2054 | 37 714 | 35 706 | 4,16 |
| 4,500 % éch. 01/02/2054 | 30 500 | 29 586 | 3,44 |
| 6,000 % éch. 01/02/2054 | 21 100 | 21 426 | 2,49 |
| | | 89 657 | 10,44 |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c) | | | |
| 0,125 % éch. 15/07/2024 | 14 772 | 14 519 | 1,69 |
| 0,125 % éch. 15/10/2024 (e) | 58 162 | 56 898 | 6,62 |
| 0,125 % éch. 15/04/2025 (e) | 36 687 | 35 381 | 4,12 |
| 0,125 % éch. 15/10/2025 (e) | 28 933 | 27 825 | 3,24 |
| 0,125 % éch. 15/04/2026 (e) | 52 478 | 49 959 | 5,82 |
| 0,125 % éch. 15/07/2026 | 7 073 | 6 740 | 0,78 |
| 0,125 % éch. 15/10/2026 (e) | 130 498 | 123 948 | 14,43 |
| 0,125 % éch. 15/07/2031 | 16 209 | 14 419 | 1,68 |
| 0,250 % éch. 15/01/2025 (e) | 45 076 | 43 756 | 5,09 |
| 0,250 % éch. 15/07/2029 | 1 937 | 1 790 | 0,21 |
| 0,375 % éch. 15/07/2025 | 20 219 | 19 592 | 2,28 |
| 0,375 % éch. 15/01/2027 (e) | 34 212 | 32 519 | 3,79 |
| 0,375 % éch. 15/07/2027 (e) | 40 349 | 38 351 | 4,47 |
| 0,500 % éch. 15/04/2024 | 37 | 36 | 0,00 |
| 0,500 % éch. 15/01/2028 | 41 661 | 39 435 | 4,59 |
| 0,625 % éch. 15/01/2026 | 21 132 | 20 393 | 2,37 |
| 0,750 % éch. 15/07/2028 | 22 222 | 21 274 | 2,48 |
| 0,750 % éch. 15/02/2045 | 784 | 614 | 0,07 |
| 0,875 % éch. 15/01/2029 | 25 954 | 24 848 | 2,89 |
| 0,875 % éch. 15/02/2047 | 892 | 704 | 0,08 |
| 1,250 % éch. 15/04/2028 | 15 592 | 15 191 | 1,77 |
| 1,375 % éch. 15/07/2033 | 8 408 | 8 158 | 0,95 |
| 1,375 % éch. 15/02/2044 | 3 036 | 2 717 | 0,32 |
| 1,625 % éch. 15/10/2027 (e) | 96 645 | 95 941 | 11,17 |
| 1,750 % éch. 15/01/2028 | 5 211 | 5 180 | 0,60 |
| 2,375 % éch. 15/01/2025 | 17 465 | 17 330 | 2,02 |
| 2,500 % éch. 15/01/2029 | 1 733 | 1 792 | 0,21 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|--------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 3,875 % éch. 15/04/2029 | \$ 1 218 | \$ 1 344 | 0,16 | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| | | 720 654 | 83,90 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (d) | 12 743 | \$ 127 | 0,01 |
| Total États-Unis | | 838 128 | 97,58 | Total des Fonds d'investissement | | \$ 127 | 0,01 |
| INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | | | | |
| BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | | | | |
| 10,900 % éch. 04/01/2024 (a)(b) | HUF 422 000 | 1 219 | 0,14 | | | | |
| Total des Instruments à court terme | | 1 219 | 0,14 | | | | |
| Total des Valeurs mobilières | \$ 1 293 427 | 150,60 | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|----------------|--------------------------|--------------------------|----------------------|--|---------------------|--|--|---------------------|
| BPS | 5,470 % | 02/01/2024 | 03/01/2024 | \$ 40 300 | Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032 | \$ (41 183) | \$ 40 300 | \$ 40 306 | 4,69 |
| FICC | 2,600 5,330 | 29/12/2023 29/12/2023 | 02/01/2024 02/01/2024 | 1 018 41 700 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 Billets du Trésor américain 1,500 % éch. 30/11/2028 | (1 038) (42 534) | 1 018 41 700 | 1 018 41 700 | 0,12 4,86 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (84 755) | \$ 83 018 | \$ 83 024 | 9,67 |

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)**

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars | Court | 03/2024 | 69 | \$ (50) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 63 | (148) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Long | 03/2024 | 53 | 113 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 82 | 400 | 0,05 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Court | 03/2024 | 355 | (281) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 86 | (155) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 18 | (228) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 15 | (62) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 267 | (59) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 62 | 4 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 2 006 | (4 398) | (0,51) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 416 | 4 973 | 0,58 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 274 | (1 562) | (0,18) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 540 | (5 295) | (0,62) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 123 | 1 581 | 0,19 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 87 | 764 | 0,09 |
| | | | | \$ (4 403) | (0,51) |

OPTIONS VENDUES**OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE**

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-----------------|-------------------|------------------|----------|-------------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor avril 2024 | \$ 96,750 | 12/04/2024 | 312 | \$ (211) | \$ (211) | (0,03) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | | \$ (4 614) | (0,54) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|---|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,300 % | 20/09/2027 | ¥ 74 880 | \$ 3 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 15/12/2031 | 986 000 | 91 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,550 | 14/09/2028 | 2 370 000 | (89) | (0,01) |
| À recevoir | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/12/2047 | \$ 1 750 | 380 | 0,04 |
| À recevoir | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,428 | 20/12/2047 | 400 | 59 | 0,01 |
| À recevoir | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,478 | 20/12/2047 | 1 115 | 152 | 0,02 |

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|---|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,499 % | 20/12/2047 | \$ 570 | \$ 77 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,840 | 21/11/2028 | 13 800 | 1 275 | 0,15 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,880 | 25/01/2052 | 5 000 | (1 514) | (0,18) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,888 | 21/11/2053 | 2 800 | (902) | (0,11) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,237 | 21/11/2053 | 10 300 | 2 004 | 0,23 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,340 | 21/11/2028 | 50 700 | (2 886) | (0,34) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,865 | 13/02/2054 | 18 600 | 1 095 | 0,13 |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,085 | 13/02/2034 | 41 800 | (909) | (0,11) |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 22/03/2026 | 17 750 | 30 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 58 000 | (482) | (0,06) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,606 | 31/10/2025 | 48 600 | 558 | 0,06 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,611 | 31/10/2025 | 6 800 | 79 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,868 | 22/12/2025 | 17 750 | (185) | (0,02) |
| À recevoir | BBR NZD à 3 mois | 3,250 | 21/03/2028 | NZD 900 | 13 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,000 | 17/03/2053 | € 1 200 | 544 | 0,06 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,190 | 04/11/2052 | 900 | 393 | 0,05 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,195 | 04/11/2052 | 950 | 472 | 0,06 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,197 | 08/11/2052 | 1 600 | 696 | 0,08 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | 200 | (7) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | 4 900 | (317) | (0,04) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 2 400 | (145) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 2 100 | (133) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 4 700 | (233) | (0,03) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 2 100 | (103) | (0,01) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 25 470 | (3 467) | (0,40) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,879 | 15/08/2032 | 13 400 | 409 | 0,05 |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 53 680 | 3 887 | 0,45 |
| À payer | CPTFEMU | 1,380 | 15/03/2031 | 4 000 | (817) | (0,10) |
| À payer | CPTFEMU | 1,946 | 15/03/2048 | 60 | (14) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,356 | 15/11/2033 | 3 200 | 78 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,363 | 15/11/2033 | 1 800 | 43 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,390 | 15/11/2033 | 1 800 | 46 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,421 | 15/05/2052 | 700 | (54) | (0,01) |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,470 | 15/07/2032 | 11 900 | 8 | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,488 | 15/05/2037 | 4 790 | (150) | (0,02) |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,548 | 15/11/2053 | 500 | (16) | 0,00 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,570 | 15/06/2032 | 8 800 | 54 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,580 | 15/03/2052 | 500 | (20) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,590 | 15/03/2052 | 4 940 | (147) | (0,02) |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,600 | 15/05/2032 | 10 600 | 162 | 0,02 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,620 | 15/11/2053 | 200 | (12) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,680 | 15/04/2053 | 2 100 | 163 | 0,02 |
| À payer | CPTFEMU | 2,682 | 15/10/2053 | 600 | 49 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,700 | 15/04/2053 | 1 100 | 87 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,736 | 15/10/2053 | 900 | 83 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,763 | 15/09/2053 | 1 800 | 191 | 0,02 |
| À recevoir | CPTFEMU | 4,470 | 15/09/2024 | 19 900 | (184) | (0,02) |
| À recevoir | CPURNSA | 1,798 | 25/08/2027 | \$ 1 000 | 146 | 0,02 |
| À recevoir | CPURNSA | 1,890 | 27/08/2027 | 3 000 | 417 | 0,05 |
| À payer | CPURNSA | 1,954 | 03/06/2029 | 700 | (92) | (0,01) |
| À payer | CPURNSA | 1,998 | 25/07/2029 | 3 600 | (455) | (0,05) |
| À payer | CPURNSA | 2,155 | 17/10/2027 | 1 900 | (216) | (0,03) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,311 | 24/02/2031 | 5 100 | 531 | 0,06 |
| À payer | CPURNSA | 2,335 | 05/02/2028 | 2 680 | (243) | (0,03) |
| À payer | CPURNSA | 2,353 | 09/05/2028 | 1 790 | (153) | (0,02) |
| À payer | CPURNSA | 2,360 | 09/05/2028 | 2 690 | (227) | (0,03) |
| À payer | CPURNSA | 2,364 | 10/05/2028 | 2 750 | (231) | (0,03) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,419 | 05/03/2026 | 2 300 | 215 | 0,03 |
| À payer | CPURNSA | 2,560 | 12/09/2024 | 3 400 | 5 | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 2,565 | 12/09/2024 | 5 000 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,573 | 26/08/2028 | 1 100 | 65 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,645 | 10/09/2028 | 1 500 | 78 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,690 | 01/06/2026 | 2 100 | 156 | 0,02 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,703 | 25/05/2026 | 1 270 | 94 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,768 | 13/05/2026 | 3 100 | 224 | 0,03 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,813 | 14/05/2026 | 1 400 | 98 | 0,01 |
| À recevoir | FRCPXTOB | 1,030 | 15/03/2024 | € 3 300 | 312 | 0,04 |
| À payer | FRCPXTOB | 1,910 | 15/01/2038 | 390 | (47) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,100 | 15/06/2031 | £ 2 300 | (455) | (0,05) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,400 | 15/06/2030 | 1 610 | (371) | (0,04) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,530 | 15/10/2031 | 540 | (129) | (0,02) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,066 | 15/09/2031 | 300 | (43) | 0,00 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,125 | 15/09/2032 | 590 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,130 | 15/09/2032 | 2 610 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,143 | 15/10/2032 | 2 300 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 5,200 | 15/06/2024 | 1 200 | 62 | 0,01 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 6,600 | 15/05/2024 | 4 200 | 223 | 0,03 |
| | | | | | \$ 360 | 0,04 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 360 | 0,04 |

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description | Indice initial | Taux variable | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 100,151 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035 | 1 200 | \$ (54) | \$ (44) | (0,01) |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,700 % | 13/02/2024 | 34 100 | \$ (149) | \$ (505) | (0,06) |
| BRC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 3,150 | 06/10/2025 | 13 100 | (151) | (340) | (0,04) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,150 | 06/10/2025 | 13 100 | (151) | (55) | (0,01) |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,950 | 15/09/2025 | 10 800 | (131) | (252) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,950 | 15/09/2025 | 10 800 | (131) | (59) | (0,01) |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,760 | 16/01/2024 | 29 500 | (137) | (416) | (0,05) |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,900 | 20/03/2024 | 35 500 | (171) | (198) | (0,02) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,900 | 29/08/2025 | 6 800 | (89) | (149) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,900 | 29/08/2025 | 6 800 | (88) | (34) | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,800 | 01/09/2025 | 14 600 | (185) | (298) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,800 | 01/09/2025 | 14 600 | (185) | (81) | (0,01) |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,758 | 16/01/2024 | 4 000 | (18) | (56) | (0,01) |
| | | | | | | | \$ (1 586) | \$ (2 443) | (0,28) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| DUB | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 % | 17/10/2057 | \$ 1 497 | \$ (104) | \$ 105 | \$ 1 | 0,00 |
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17/10/2057 | 1 796 | (93) | 94 | 1 | 0,00 |
| | | | | | \$ (197) | \$ 199 | \$ 2 | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 1,998 % | 20/06/2028 | ILS 890 | \$ 0 | \$ (12) | \$ (12) | 0,00 |
| BRC | À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 1,950 | 20/06/2028 | 810 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| CKL | À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 2,100 | 20/06/2028 | 750 | (3) | (6) | (9) | 0,00 |
| GLM | À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 1,971 | 16/02/2028 | 1 430 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| | À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 1,998 | 20/06/2028 | 610 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| HUS | À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 1,998 | 20/06/2028 | 480 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | \$ (3) | \$ (59) | \$ (62) | (0,01) |

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-----------------|----------------------------|--|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS | À recevoir | Indice BCOMTR | 9 630 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | \$ 2 182 | 15/02/2024 | \$ 0 | \$ (6) | \$ (6) | 0,00 |
| | À recevoir | Indice BCOMTR1 | 1 368 505 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 118 440 | 15/02/2024 | 0 | (388) | (388) | (0,05) |
| CBK | À recevoir | Indice BCOMF1TC | 348 889 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 39 186 | 15/02/2024 | 0 | (128) | (128) | (0,02) |
| | À recevoir | Indice BCOMTR | 18 369 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 4 161 | 15/02/2024 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | À recevoir | Indice CIXBSTR3 | 693 551 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 172 357 | 15/02/2024 | 0 | (448) | (448) | (0,05) |
| CIB | À recevoir | Indice BCOMTR | 41 476 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 9 396 | 15/02/2024 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| GST | À recevoir | Indice BCOMF1TC | 235 692 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 85 844 | 15/02/2024 | 0 | (281) | (281) | (0,03) |
| | À recevoir | Indice BCOMTR | 882 893 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 200 018 | 15/02/2024 | 0 | (585) | (585) | (0,07) |

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

| Contrepartie | À payer/ à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/ (reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|---|----------------------|--------------------|----------------------------|---|-----------------|------------------------|
| | | | | | | | | | | |
| JPM | À recevoir | Indice BCOMF1TC Index | 315 223 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | \$ 60 047 | 15/02/2024 | \$ 0 | \$ (197) | \$ (197) | (0,02) |
| | À recevoir | Indice BCOMTR Index | 200 746 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 45 479 | 15/02/2024 | 112 | (268) | (156) | (0,02) |
| | À recevoir | Indice JMABDEWU Index | 494 170 | 0,053 % | 79 894 | 15/02/2024 | 0 | (176) | (176) | (0,02) |
| | À recevoir | Indice JMABNIU5 Index | 164 986 | 0,000 | 29 639 | 15/02/2024 | 0 | (265) | (265) | (0,03) |
| MAC | À recevoir | Indice PIMCOBBV Index | 155 117 | 0,600 | 20 171 | 16/01/2024 | 0 | 105 | 105 | 0,01 |
| | À recevoir | Indice PIMCOBDU Index | 539 651 | 0,150 | 85 338 | 15/03/2024 | 0 | (527) | (527) | (0,06) |
| MEI | À recevoir | Indice BCOMTR Index | 46 584 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 10 553 | 15/02/2024 | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| SOG | À recevoir | Indice BCOMTR Index | 9 776 | Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné | 2 215 | 15/02/2024 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | \$ 112 | \$ (3 243) | \$ (3 131) | (0,37) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|-----------|----------------------|-----------------------|--------------------------|---|------------------------|
| | | | | | | | | |
| AZD | 01/2024 | AUD | 5 456 | \$ 3 613 | \$ 0 | \$ (110) | \$ (110) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | | 828 | 547 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 3 027 | 3 844 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 4 487 180 | 30 407 | 0 | (1 442) | (1 442) | (0,17) |
| | 01/2024 | NZD | 3 042 | 1 853 | 0 | (73) | (73) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH | 51 959 | 7 228 | 0 | (111) | (111) | (0,01) |
| | 06/2024 | KRW | 4 665 657 | 3 586 | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| BPS | 01/2024 | DKK | 60 049 | 8 853 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 01/2024 | € | 1 648 | 1 780 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 11 024 | 13 983 | 0 | (71) | (71) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF | 107 077 | 305 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 2 733 187 | 18 638 | 0 | (761) | (761) | (0,09) |
| | 01/2024 | KRW | 65 689 | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 611 | € 553 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 | HUF 817 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 100 | IDR 1 546 618 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 333 | ZAR 61 784 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | € | 209 914 | \$ 230 860 | 0 | (1 076) | (1 076) | (0,12) |
| | 01/2024 | KRW | 129 230 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 913 | £ 717 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 942 | MXN 34 068 | 61 | 0 | 61 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 99 | ZAR 1 849 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 999 | IDR 31 076 634 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | AUD | 311 | \$ 210 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK | 3 035 | 444 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 8 053 | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR | 1 542 854 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS | 327 | 90 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 2 078 | 552 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 100 | IDR 1 543 250 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 64 985 | \$ 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | CAD | 15 561 | 11 451 | 0 | (352) | (352) | (0,04) |
| GLM | 01/2024 | DKK | 73 154 | 10 791 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 1 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | HUF | 294 979 | 840 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 100 | IDR 1 538 700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 50 | KRW 64 807 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 2 750 | BRL 13 485 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| MBC | 06/2024 | KRW | 64 252 | \$ 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD | 2 560 | 1 697 | 0 | (50) | (50) | (0,01) |
| MYI | 01/2024 | \$ | 18 921 | € 17 304 | 199 | 0 | 199 | 0,02 |
| | 01/2024 | £ | 28 | \$ 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 11 276 | 32 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 1 704 524 | 11 562 | 0 | (537) | (537) | (0,06) |
| | 01/2024 | SGD | 48 | 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 8 733 | DKK 59 455 | 80 | 0 | 80 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 828 | € 746 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 10 | £ 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 03/2024 | | 100 | IDR 1 549 650 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK | 143 538 | \$ 13 821 | 0 | (426) | (426) | (0,05) |
| | 01/2024 | \$ | 35 | € 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 495 | £ 389 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 054 | MXN 18 509 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 169 260 | \$ 5 442 | 0 | (167) | (167) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ | 1 812 | INR 151 532 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD | 2 069 | \$ 1 373 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ | 59 889 | 75 791 | 0 | (558) | (558) | (0,06) |
| | 01/2024 | ¥ | 179 577 | 1 226 | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 158 | MXN 2 776 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 723 | INR 144 139 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | | \$ 470 | \$ (6 078) | \$ (5 608) | (0,65) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| BPS | 01/2024 | € | 9 257 | \$ 10 101 | \$ 3 | \$ (130) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 8 355 | € 7 590 | 32 | 0 | 0,00 | |
| BRC | 01/2024 | | 87 498 | 79 560 | 408 | 0 | 0,05 | |
| CBK | 01/2024 | € | 5 437 | \$ 5 896 | 0 | (112) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 2 184 | € 1 974 | 0 | (4) | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | € | 4 368 | \$ 4 765 | 0 | (61) | (0,01) | |
| MYI | 01/2024 | \$ | 87 446 | € 79 560 | 460 | 0 | 0,05 | |
| UAG | 01/2024 | | 87 513 | 79 560 | 393 | 0 | 0,05 | |
| | | | | | \$ 1 296 | \$ (307) | \$ 989 | 0,12 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| BOA | 01/2024 | \$ | 880 | £ 694 | \$ 5 | \$ 0 | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | | 1 376 | 1 084 | 7 | 0 | 0,00 | |
| BRC | 01/2024 | | 28 | 22 | 0 | 0 | 0,00 | |
| CBK | 01/2024 | £ | 66 | \$ 83 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 359 | £ 283 | 2 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | £ | 68 | \$ 87 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | | 234 | 295 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 560 | £ 442 | 4 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | | 9 | 7 | 0 | 0 | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | | 7 794 | 6 162 | 61 | 0 | 0,01 | |
| SSB | 01/2024 | £ | 488 | \$ 614 | 0 | (8) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 6 074 | £ 4 813 | 63 | 0 | 0,01 | |
| UAG | 01/2024 | £ | 17 | \$ 21 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 7 793 | £ 6 158 | 57 | 0 | 0,01 | |
| | | | | | \$ 199 | \$ (12) | \$ 187 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| BOA | 01/2024 | \$ | 280 | SGD 373 | \$ 3 | \$ 0 | 0,00 | |
| CBK | 01/2024 | | 280 | 373 | 3 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | SGD | 18 | \$ 13 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 19 | SGD 25 | 0 | 0 | 0,00 | |
| JPM | 01/2024 | SGD | 9 | \$ 7 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 41 | SGD 54 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | SGD | 44 | \$ 33 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 51 | SGD 68 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 9 | 11 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | | 255 | 340 | 3 | 0 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | | 2 | 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | | | | | \$ 10 | \$ 0 | \$ 10 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (10 100) (1,18)

Total des Investissements

\$ 1 362 218 158,60

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (503 316) (58,60)

Actifs nets

\$ 858 902 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Affilié au Fonds.

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 397 126 \$ (31 décembre 2022 : 400 193 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 17 272 \$) ont été nantis en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

Des titres d'une juste valeur globale de 777 \$ (31 décembre 2022 : 157 \$) et un montant en numéraire de 935 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 10 174 \$ (31 décembre 2022 : 19 275 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 5 750 \$ (31 décembre 2022 : 18 770 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques | Autres données significatives observables | Données significatives non observables | Juste valeur |
|---|--|---|--|---------------------|
| | (Niveau 1) | (Niveau 2) | (Niveau 3) | |
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 293 241 | \$ 186 | \$ 1 293 427 |
| Fonds d'investissement | 127 | 0 | 0 | 127 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 83 018 | 0 | 83 018 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 83 | (14 437) | 0 | (14 354) |
| Totaux | \$ 210 | \$ 1 361 822 | \$ 186 | \$ 1 362 218 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques | Autres données significatives observables | Données significatives non observables | Juste valeur |
|---|--|---|--|---------------------|
| | (Niveau 1) | (Niveau 2) | (Niveau 3) | |
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 750 918 | \$ 0 | \$ 1 750 918 |
| Fonds d'investissement | 120 | 0 | 0 | 120 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 59 113 | 0 | 59 113 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 8 938 | (13 669) | 0 | (4 731) |
| Totaux | \$ 9 058 | \$ 1 796 362 | \$ 0 | \$ 1 805 420 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BSN | 5,510 % | 14/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (60 895) | \$ (61 063) | (7,11) |
| CIB | 5,470 | 07/12/2023 | 04/01/2024 | (107 969) | (108 379) | (12,62) |
| | 5,470 | 13/12/2023 | 04/01/2024 | (36 056) | (36 160) | (4,21) |
| | 5,470 | 14/12/2023 | 04/01/2024 | (78 712) | (78 928) | (9,19) |
| | 5,470 | 19/12/2023 | 04/01/2024 | (70 262) | (70 400) | (8,19) |
| GRE | 5,520 | 18/12/2023 | 04/01/2024 | (41 040) | (41 128) | (4,79) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (396 058) | (46,11) |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (110) | \$ 0 | \$ (110) | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | (1 708) | 1 650 | (58) | (97) | 0 | (97) |
| BPS | (1 871) | 690 | (1 181) | (3 167) | 4 390 | 1 223 |
| BRC | (994) | 1 770 | 776 | 311 | (320) | (9) |
| CBK | (1 028) | (1 270) | (2 298) | 2 368 | (1 310) | 1 058 |
| CIB | (27) | 0 | (27) | (334) | 470 | 136 |
| CKL | (9) | 0 | (9) | (14) | 0 | (14) |
| DUB | 1 | 0 | 1 | (1 532) | 1 480 | (52) |
| FAR | (416) | 400 | (16) | S/O | S/O | S/O |
| FBF | S/O | S/O | S/O | (181) | 80 | (101) |
| GLM | (853) | 690 | (163) | (384) | 260 | (124) |
| GSC | S/O | S/O | S/O | (3) | 0 | (3) |
| GST | (1 244) | (1 480) | (2 724) | (3 474) | 4 890 | 1 416 |
| HUS | (6) | 0 | (6) | (10) | 0 | (10) |
| JPM | (784) | (390) | (1 174) | (272) | 1 520 | 1 248 |
| MAC | (422) | (10) | (432) | 1 137 | (840) | 297 |
| MBC | 90 | 0 | 90 | (3 160) | 2 770 | (390) |
| MEI | (33) | 0 | (33) | (251) | 320 | 69 |
| MYC | (56) | 0 | (56) | (26) | 260 | 234 |

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| MYI | \$ 3 | \$ (530) | \$ (527) | \$ (2 190) | \$ 1 630 | \$ (560) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (1) | 0 | (1) |
| SAL | S/O | S/O | S/O | (6) | 100 | 94 |
| SCX | (494) | 550 | 56 | 4 186 | (4 010) | 176 |
| SOG | (7) | 0 | (7) | (497) | 570 | 73 |
| SSB | 55 | 0 | 55 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | (187) | 0 | (187) | (10) | 30 | 20 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 128,93 | 108,79 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 21,67 | 18,76 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 0,26 |
| Fonds d'investissement | 0,01 | 0,01 |
| Contrats de mise en pension | 9,67 | 4,32 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,54) | 0,64 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,04 | (0,43) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (1,18) | (0,56) |
| Contrats de prise en pension | (46,11) | (31,05) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | S/O | (1,31) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Australie | 0,88 | 0,51 |
| Canada | 0,29 | 0,18 |
| Îles Caïmans | 4,88 | 5,01 |
| Danemark | 1,33 | 3,73 |
| France | 4,65 | 5,36 |
| Allemagne | S/O | 1,07 |
| Irlande | 6,06 | 4,58 |
| Italie | 10,15 | 6,97 |
| Japon | 7,70 | 4,89 |
| Pays-Bas | S/O | 0,03 |
| Nouvelle-Zélande | 0,24 | 0,14 |
| Pérou | 0,01 | 0,04 |
| Qatar | S/O | 0,02 |
| Arabie saoudite | S/O | 0,02 |
| Espagne | 3,94 | 3,61 |
| Suède | 1,68 | 0,99 |
| Suisse | 0,12 | S/O |
| Royaume-Uni | 10,95 | 8,89 |
| États-Unis | 97,58 | 81,68 |
| Instruments à court terme | 0,14 | 0,09 |
| Fonds d'investissement | 0,01 | 0,01 |
| Contrats de mise en pension | 9,67 | 4,32 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,51) | 0,64 |
| Options vendues | | |
| Option de style contrat à terme standardisé sur matières premières | (0,03) | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,04 | (0,43) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,22 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Options plafonnées sur l'inflation | (0,01) | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,28) | (0,35) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,01) | (0,01) |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,37) | (0,68) |
| Contrats de change à terme | (0,65) | (0,62) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,14 | 0,88 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (58,60) | (31,79) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | CHINE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| ARGENTINE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Yango Justice International Ltd. | | | | 2,750 % éch. 27/11/2031 (d) MXN | | | |
| Obligation internationale du gouvernement argentin | | | | 7,500 % éch. 15/04/2024 ^ | | | | \$ 200 \$ 1 0,00 | | | |
| 1,000 % éch. 09/07/2029 | | | | 9,250 % éch. 15/04/2023 ^ | | | | 200 1 0,00 | | | |
| 3,500 % éch. 09/07/2041 | | | | Total Chine | | | | 2 0,00 | | | |
| Provincia de Buenos Aires | | | | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 129,126 % éch. 12/04/2025 (a) ARS | | | | EP Infrastructure A/S | | | | 1,816 % éch. 02/03/2031 | | | |
| 20 | | | | 0 0,00 | | | | € 400 343 0,34 | | | |
| Total Argentine | | | | 278 0,28 | | | | 2,045 % éch. 09/10/2028 | | | |
| AUSTRALIE | | | | Total République tchèque | | | | 528 0,53 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | FRANCE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Santos Finance Ltd. | | | | Altice France S.A. | | | | 5,125 % éch. 15/07/2029 | | | |
| 3,649 % éch. 29/04/2031 | | | | 3,337 % éch. 21/01/2033 | | | | \$ 365 284 0,28 | | | |
| \$ 1 100 959 0,96 | | | | BNP Paribas S.A. | | | | 7,750 % éch. | | | |
| Virgin Australia Holdings Pty. Ltd | | | | 16/08/2029 (e)(g) | | | | 200 205 0,21 | | | |
| 8,125 % éch. 15/11/2024 ^ | | | | Société Générale S.A. | | | | 3,337 % éch. 21/01/2033 | | | |
| 377 | | | | 2 0,00 | | | | 450 379 0,38 | | | |
| Total Australie | | | | 961 0,96 | | | | 6,691 % éch. 10/01/2034 | | | |
| BERMUDES | | | | Total France | | | | 500 529 0,53 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | IRLANDE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| VOC Escrow Ltd. | | | | AerCap Ireland Capital DAC | | | | 2,875 % éch. 14/08/2024 | | | |
| 5,000 % éch. 15/02/2028 | | | | 1 150 | | | | 1 129 1,13 | | | |
| 700 671 0,67 | | | | ITALIE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| CANADA | | | | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | | | | 6,750 % éch. 05/09/2027 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Intesa Sanpaolo SpA | | | | 4,950 % éch. 01/06/2042 | | | |
| Air Canada Pass-Through Trust | | | | Mundys SpA | | | | 1,875 % éch. 12/02/2028 | | | |
| 3,300 % éch. 15/07/2031 | | | | 37 34 0,03 | | | | € 700 712 0,71 | | | |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. | | | | 6,000 % éch. 07/12/2033 | | | | Nexi SpA | | | |
| 50 | | | | 51 0,05 | | | | 2,125 % éch. 30/04/2029 | | | |
| 85 0,08 | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA | | | |
| Bausch & Lomb Corp. | | | | 9,356 % éch. 29/09/2028 | | | | 3,500 % éch. 09/10/2025 | | | |
| 499 | | | | 499 0,50 | | | | 200 217 0,22 | | | |
| Total Canada | | | | 584 0,58 | | | | Telecom Italia SpA | | | |
| ÎLES CAIMANS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | | 7,875 % éch. 31/07/2028 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Sunac China Holdings Ltd. | | | | 200 205 0,21 | | | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. | | | | 1,000 % éch. 30/09/2032 | | | | 28 2 0,00 | | | |
| 2,528 % éch. 18/11/2027 | | | | 800 710 0,71 | | | | LIBÉRIA | | | |
| 3,950 % éch. 01/07/2024 | | | | 100 99 0,10 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| GGAM Finance Ltd. | | | | 8,000 % éch. 15/02/2027 | | | | Royal Caribbean Cruises Ltd. | | | |
| 200 | | | | 205 0,21 | | | | 4,250 % éch. 01/07/2026 | | | |
| Kaisa Group Holdings Ltd. | | | | 11,500 % éch. 30/01/2023 ^ | | | | \$ 500 483 0,48 | | | |
| 600 | | | | 20 0,02 | | | | LUXEMBOURG | | | |
| Melco Resorts Finance Ltd. | | | | 5,625 % éch. 17/07/2027 | | | | ACTIONS | | | |
| 725 | | | | 680 0,68 | | | | ACTIONS ORDINAIRES | | | |
| MGM China Holdings Ltd. | | | | 4,750 % éch. 01/02/2027 | | | | Intelsat Emergence | | | |
| 900 | | | | 857 0,86 | | | | S.A. (c)(h) | | | |
| Sands China Ltd. | | | | 3,500 % éch. 08/08/2031 | | | | 7 496 | | | |
| 300 577 0,58 | | | | 4,300 % éch. 08/01/2026 | | | | 214 0,21 | | | |
| 600 577 0,58 | | | | 4,625 % éch. 18/06/2030 | | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | |
| 300 273 0,27 | | | | 5,650 % éch. 08/08/2028 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 100 99 0,10 | | | | Sunac China Holdings Ltd. | | | | Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en | | | |
| 32 3 0,00 | | | | 6,250 % éch. 30/09/2027 | | | | numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) | | | |
| 32 3 0,00 | | | | 6,500 % éch. 30/09/2027 | | | | 3,000 % éch. 31/12/2026 (b) | | | |
| 64 5 0,01 | | | | 6,750 % éch. 30/09/2028 | | | | \$ 525 382 0,38 | | | |
| 96 4 0,00 | | | | 7,000 % éch. 30/09/2029 | | | | Intelsat Jackson Holdings S.A. | | | |
| 96 5 0,01 | | | | 7,250 % éch. 30/09/2030 | | | | 6,500 % éch. 15/03/2030 | | | |
| 45 2 0,00 | | | | Transocean Titan Financing Ltd. | | | | 562 536 0,54 | | | |
| 300 311 0,31 | | | | 8,375 % éch. 01/02/2028 | | | | 918 0,92 | | | |
| Wynn Macau Ltd. | | | | 5,125 % éch. 15/12/2029 | | | | Total Luxembourg | | | |
| 375 334 0,33 | | | | 5,500 % éch. 01/10/2027 | | | | 1 132 1,13 | | | |
| 100 95 0,09 | | | | 4 869 4,87 | | | | MEXIQUE | | | |
| Total Îles Caïmans | | | | 4 871 4,87 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | Petroleos Mexicanos | | | | 10,000 % éch. 07/02/2033 | | | |
| | | | | 100 100 0,10 | | | | Total Mexique | | | |
| | | | | | | | | 497 0,50 | | | |
| | | | | | | | | MULTINATIONALES | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Delta Air Lines, Inc. | | | |
| | | | | | | | | 4,750 % éch. 20/10/2028 | | | |
| | | | | | | | | \$ 400 394 0,39 | | | |
| | | | | | | | | PAYS-BAS | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | JT International Financial Services BV | | | |
| | | | | | | | | 3,875 % éch. 28/09/2028 | | | |
| | | | | | | | | 200 191 0,19 | | | |
| | | | | | | | | Prosus NV | | | |
| | | | | | | | | 3,832 % éch. 08/02/2051 | | | |
| | | | | | | | | 300 189 0,19 | | | |
| | | | | | | | | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV | | | |
| | | | | | | | | 3,150 % éch. 01/10/2026 | | | |
| | | | | | | | | 600 556 0,55 | | | |
| | | | | | | | | Total Pays-Bas | | | |
| | | | | | | | | 936 0,93 | | | |
| | | | | | | | | PANAMA | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Carnival Corp. | | | |
| | | | | | | | | 4,000 % éch. 01/08/2028 | | | |
| | | | | | | | | 1 100 1 023 1,02 | | | |
| | | | | | | | | AFRIQUE DU SUD | | | |
| | | | | | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| | | | | | | | | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | |
| | | | | | | | | 10,500 % éch. 21/12/2026 | | | |
| | | | | | | | | ZAR 26 800 1 534 1,53 | | | |
| | | | | | | | | ESPAGNE | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Cellnex Finance Co. S.A. | | | |
| | | | | | | | | 1,500 % éch. 08/06/2028 | | | |
| | | | | | | | | € 400 406 0,41 | | | |
| | | | | | | | | SUISSE | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Crédit Suisse AG | | | |
| | | | | | | | | 5,185 % éch. 31/05/2024 | | | |
| | | | | | | | | 400 443 0,44 | | | |
| | | | | | | | | UBS Group AG | | | |
| | | | | | | | | 4,988 % éch. 05/08/2033 | | | |
| | | | | | | | | \$ 500 484 0,48 | | | |
| | | | | | | | | 6,442 % éch. 11/08/2028 | | | |
| | | | | | | | | 400 416 0,42 | | | |
| | | | | | | | | 6,537 % éch. 12/08/2033 | | | |
| | | | | | | | | 250 267 0,27 | | | |
| | | | | | | | | Total Suisse | | | |
| | | | | | | | | 1 610 1,61 | | | |
| | | | | | | | | ROYAUME-UNI | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Barclays PLC | | | |
| | | | | | | | | 5,746 % éch. 09/08/2033 | | | |
| | | | | | | | | 500 506 0,51 | | | |
| | | | | | | | | Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC | | | |
| | | | | | | | | 2,950 % éch. 27/01/2029 | | | |
| | | | | | | | | 500 288 0,29 | | | |
| | | | | | | | | Grainger PLC | | | |
| | | | | | | | | 3,000 % éch. 03/07/2030 | | | |
| | | | | | | | | £ 200 219 0,22 | | | |
| | | | | | | | | HSBC Holdings PLC | | | |
| | | | | | | | | 4,600 % éch. | | | |
| | | | | | | | | 17/12/2030 (e)(g) | | | |
| | | | | | | | | \$ 300 251 0,25 | | | |
| | | | | | | | | Imperial Brands Finance PLC | | | |
| | | | | | | | | 5,500 % éch. 28/09/2026 | | | |
| | | | | | | | | £ 400 514 0,51 | | | |
| | | | | | | | | INEOS Quattro Finance PLC | | | |
| | | | | | | | | 2,500 % éch. 15/01/2026 | | | |
| | | | | | | | | € 100 107 0,11 | | | |
| | | | | | | | | John Lewis PLC | | | |
| | | | | | | | | 4,250 % éch. 18/12/2034 | | | |
| | | | | | | | | £ 300 278 0,28 | | | |
| | | | | | | | | Market Bidco Finco PLC | | | |
| | | | | | | | | 4,750 % éch. 04/11/2027 | | | |
| | | | | | | | | € 800 795 0,79 | | | |
| | | | | | | | | Royalty Pharma PLC | | | |
| | | | | | | | | 1,750 % éch. 02/09/2027 | | | |
| | | | | | | | | \$ 600 538 0,54 | | | |
| | | | | | | | | Santander UK Group Holdings PLC | | | |
| | | | | | | | | 3,823 % éch. 03/11/2028 | | | |
| | | | | | | | | 300 282 0,28 | | | |
| | | | | | | | | Virgin Media Secured Finance PLC | | | |
| | | | | | | | | 4,125 % éch. 15/08/2030 | | | |
| | | | | | | | | £ 300 330 0,33 | | | |
| | | | | | | | | Total Royaume-Uni | | | |
| | | | | | | | | 4 108 4,11 | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ÉTATS-UNIS | | | | | | | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | | | | | | | | |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,295 % éch. 25/12/2045 | \$ 268 | \$ 203 | 0,20 | Amgen, Inc. 5,150 % éch. 02/03/2028 | 400 | 410 | 0,41 | EPR Properties 4,500 % éch. 01/06/2027 | \$ 50 | \$ 47 | 0,05 |
| Argent Securities Trust 5,620 % éch. 25/09/2036 | 752 | 242 | 0,24 | 5,250 % éch. 02/03/2030 | 600 | 617 | 0,62 | Ford Motor Credit Co. LLC 3,375 % éch. 13/11/2025 | 200 | 191 | 0,19 |
| 5,830 % éch. 25/04/2036 | 264 | 86 | 0,09 | Ares Capital Corp. 7,000 % éch. 15/01/2027 | 300 | 309 | 0,31 | 4,389 % éch. 08/01/2026 | 700 | 681 | 0,68 |
| 6,030 % éch. 25/04/2036 | 646 | 210 | 0,21 | Ashtead Capital, Inc. 4,375 % éch. 15/08/2027 | 800 | 769 | 0,77 | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 7,875 % éch. 01/12/2030 | 200 | 209 | 0,21 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust 5,790 % éch. 25/12/2036 | 1 561 | 872 | 0,87 | Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc. 6,125 % éch. 15/09/2028 | 100 | 105 | 0,10 | FS KKR Capital Corp. 7,875 % éch. 15/01/2029 | 100 | 106 | 0,11 |
| First Franklin Mortgage Loan Trust 6,895 % éch. 25/10/2034 | 260 | 260 | 0,26 | Avangrid, Inc. 3,150 % éch. 01/12/2024 | 150 | 147 | 0,15 | Genesis Energy LP 8,250 % éch. 15/01/2029 | 100 | 103 | 0,10 |
| GSAMP Trust 5,560 % éch. 25/01/2037 | 360 | 207 | 0,21 | Aviation Capital Group LLC 3,500 % éch. 01/11/2027 | 600 | 553 | 0,55 | Glencore Funding LLC 5,400 % éch. 08/05/2028 | 500 | 510 | 0,51 |
| 5,590 % éch. 25/12/2036 | 518 | 245 | 0,25 | Bank of America Corp. 3,824 % éch. 20/01/2028 | 675 | 649 | 0,65 | Global Atlantic Fin Co. 3,125 % éch. 15/06/2031 | 300 | 246 | 0,25 |
| 5,700 % éch. 25/12/2046 | 634 | 315 | 0,31 | 5,819 % éch. 15/09/2029 | 600 | 620 | 0,62 | Global Payments, Inc. 5,950 % éch. 15/08/2052 | 400 | 408 | 0,41 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,950 % éch. 25/08/2036 | 463 | 178 | 0,18 | 5,933 % éch. 15/09/2027 | 175 | 179 | 0,18 | GLP Capital LP 4,000 % éch. 15/01/2030 | 600 | 548 | 0,55 |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,471 % éch. 25/11/2037 | 68 | 24 | 0,02 | BGC Group, Inc. 8,000 % éch. 25/05/2028 | 50 | 52 | 0,05 | 4,000 % éch. 15/01/2031 | 100 | 90 | 0,09 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,600 % éch. 25/01/2037 | 336 | 149 | 0,15 | Blue Owl Finance LLC 3,125 % éch. 10/06/2031 | 600 | 495 | 0,49 | 6,750 % éch. 01/12/2033 | 100 | 108 | 0,11 |
| 5,610 % éch. 25/10/2036 | 262 | 113 | 0,11 | Blue Racer Midstream LLC 7,625 % éch. 15/12/2025 | 450 | 456 | 0,46 | Goldman Sachs Group, Inc. 5,798 % éch. 10/08/2026 | 100 | 101 | 0,10 |
| 5,770 % éch. 25/09/2036 | 1 758 | 623 | 0,62 | Boeing Co. 3,950 % éch. 01/08/2059 | 600 | 460 | 0,46 | GTCR W-2 Merger Sub LLC 7,500 % éch. 15/01/2031 | 200 | 211 | 0,21 |
| 5,930 % éch. 25/09/2036 | 58 | 25 | 0,03 | 5,705 % éch. 01/05/2040 | 600 | 621 | 0,62 | HAT Holdings LLC 3,375 % éch. 15/06/2026 | 400 | 376 | 0,38 |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 5,570 % éch. 25/04/2037 | 59 | 31 | 0,03 | 5,805 % éch. 01/05/2050 | 100 | 104 | 0,10 | 8,000 % éch. 15/06/2027 | 300 | 313 | 0,31 |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,465 % éch. 25/09/2046 | 609 | 203 | 0,20 | Booz Allen Hamilton, Inc. 3,875 % éch. 01/09/2028 | 300 | 283 | 0,28 | HCA, Inc. 3,500 % éch. 01/09/2030 | 850 | 771 | 0,77 |
| New Century Home Equity Loan Trust 8,470 % éch. 25/01/2033 | 57 | 49 | 0,05 | Boston Scientific Corp. 2,650 % éch. 01/06/2030 | 1 100 | 983 | 0,98 | Host Hotels & Resorts LP 2,900 % éch. 15/12/2031 | 500 | 420 | 0,42 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust 5,770 % éch. 25/06/2036 | 506 | 359 | 0,36 | Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % éch. 15/11/2027 | 250 | 224 | 0,22 | 3,375 % éch. 15/12/2029 | 100 | 90 | 0,09 |
| 5,770 % éch. 25/09/2036 | 825 | 344 | 0,34 | 7,800 % éch. 15/03/2028 | 25 | 25 | 0,03 | 3,500 % éch. 15/09/2030 | 925 | 826 | 0,83 |
| Option One Mortgage Loan Trust 5,720 % éch. 25/03/2037 | 485 | 237 | 0,24 | British Airways Pass-Through Trust 3,300 % éch. 15/06/2034 | 84 | 75 | 0,08 | Howard Midstream Energy Partners LLC 8,875 % éch. 15/07/2028 | 300 | 315 | 0,31 |
| Residential Asset Mortgage Products Trust 0,000 % éch. 25/12/2035 | 1 091 | 902 | 0,90 | Cantor Fitzgerald LP 7,200 % éch. 12/12/2028 | 100 | 103 | 0,10 | Hudson Pacific Properties LP 3,950 % éch. 01/11/2027 | 300 | 251 | 0,25 |
| Residential Asset Securities Corp. Trust 5,843 % éch. 25/08/2034 | 316 | 307 | 0,31 | Centene Corp. 2,450 % éch. 15/07/2028 | 625 | 557 | 0,56 | 5,950 % éch. 15/02/2028 | 100 | 88 | 0,09 |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 6,430 % éch. 25/01/2036 | 104 | 94 | 0,09 | Charles Schwab Corp. 5,916 % éch. 13/05/2026 | 100 | 98 | 0,10 | Humana, Inc. 4,875 % éch. 01/04/2030 | 500 | 507 | 0,51 |
| Soundview Home Loan Trust 5,650 % éch. 25/07/2037 | 234 | 202 | 0,20 | 6,196 % éch. 17/11/2029 | 100 | 105 | 0,10 | Hyundai Capital America 5,500 % éch. 30/03/2026 | 100 | 101 | 0,10 |
| Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 5,770 % éch. 25/09/2037 | 342 | 235 | 0,24 | Charter Communications Operating LLC 3,950 % éch. 30/06/2062 | 575 | 362 | 0,36 | 6,532 % éch. 04/08/2025 | 100 | 100 | 0,10 |
| | | 6 715 | 6,71 | Cheniere Energy Partners LP 3,250 % éch. 31/01/2032 | 600 | 512 | 0,51 | IHG Finance LLC 4,375 % éch. 28/11/2029 | € 100 | 115 | 0,11 |
| | | | | 4,500 % éch. 01/10/2029 | 700 | 670 | 0,67 | Invitation Homes Operating Partnership LP 5,450 % éch. 15/08/2030 | \$ 50 | 50 | 0,05 |
| ACTIONS | | | | | | | | | | | |
| ACTIONS ORDINAIRES | | | | | | | | | | | |
| ÉNERGIE | | | | | | | | | | | |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (c)(h) | 580 149 | 63 | 0,06 | Cheniere Energy, Inc. 4,625 % éch. 15/10/2028 | 600 | 586 | 0,59 | Ipalco Enterprises, Inc. 3,700 % éch. 01/09/2024 | 100 | 98 | 0,10 |
| SERVICES FINANCIERS | | | | | | | | | | | |
| Stearns Holdings LLC « B » (c) | 157 159 | 0 | 0,00 | Chesapeake Energy Corp. 5,500 % éch. 01/02/2026 | 100 | 99 | 0,10 | JPMorgan Chase & Co. 3,540 % éch. 01/05/2028 | 1 900 | 1 813 | 1,81 |
| Total Actions ordinaires | \$ 63 | 0,06 | | Choice Hotels International, Inc. 3,700 % éch. 01/12/2029 | 700 | 621 | 0,62 | 5,000 % éch. 01/08/2024 (e) | 100 | 99 | 0,10 |
| | | | | 3,700 % éch. 15/01/2031 | 150 | 129 | 0,13 | JPMorgan Chase Bank N.A. 5,110 % éch. 08/12/2026 | 250 | 252 | 0,25 |
| | | | | Clearway Energy Operating LLC 4,750 % éch. 15/03/2028 | 275 | 265 | 0,26 | Kinetik Holdings LP 6,625 % éch. 15/12/2028 | 100 | 102 | 0,10 |
| | | | | Concentrix Corp. 6,650 % éch. 02/08/2026 | 250 | 256 | 0,26 | Las Vegas Sands Corp. 3,200 % éch. 08/08/2024 | 200 | 196 | 0,20 |
| | | | | Continental Resources, Inc. 5,750 % éch. 15/01/2031 | 500 | 498 | 0,50 | Leidos, Inc. 2,300 % éch. 15/02/2031 | 1 200 | 1 005 | 1,00 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | |
| Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % éch. 15/02/2029 | \$ 306 | 298 | 0,30 | Credit Acceptance Corp. 9,250 % éch. 15/12/2028 | 200 | 213 | 0,21 | Marvell Technology, Inc. 5,750 % éch. 15/02/2029 | 20 | 21 | 0,02 |
| Allstate Corp. 8,579 % éch. 15/08/2053 | 100 | 99 | 0,10 | Diamond Sports Group LLC 5,375 % éch. 15/08/2026 ^ | 400 | 20 | 0,02 | Mattel, Inc. 3,375 % éch. 01/04/2026 | 900 | 857 | 0,86 |
| Ally Financial, Inc. 4,750 % éch. 09/06/2027 | 600 | 579 | 0,58 | Edison International 6,950 % éch. 15/11/2029 | 100 | 109 | 0,11 | Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % éch. 20/06/2027 | 70 | 70 | 0,07 |
| American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % éch. 01/11/2028 | 345 | 317 | 0,32 | Elevance Health, Inc. 2,250 % éch. 15/05/2030 | 600 | 520 | 0,52 | Moody's Corp. 3,100 % éch. 29/11/2061 | 475 | 322 | 0,32 |
| American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 4,000 % éch. 15/01/2028 | 500 | 474 | 0,47 | Endeavor Energy Resources LP 5,750 % éch. 30/01/2028 | 325 | 325 | 0,32 | Morgan Stanley 4,210 % éch. 20/04/2028 | 500 | 489 | 0,49 |
| American Homes 4 Rent LP 3,375 % éch. 15/07/2051 | 600 | 412 | 0,41 | Energy Transfer LP 4,950 % éch. 15/06/2028 | 300 | 299 | 0,30 | 4,889 % éch. 20/07/2033 | 1 300 | 1 268 | 1,27 |
| American Tower Corp. 2,700 % éch. 15/04/2031 | 300 | 258 | 0,26 | 5,000 % éch. 15/05/2044 | 500 | 440 | 0,44 | MSCI, Inc. 3,625 % éch. 01/11/2031 | 1 100 | 969 | 0,97 |
| 2,950 % éch. 15/01/2051 | 1 125 | 751 | 0,75 | Entergy Corp. 3,750 % éch. 15/06/2050 | 100 | 76 | 0,08 | 4,000 % éch. 15/11/2029 | 100 | 94 | 0,09 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|--------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|--|-----------------------------------|----------------------------|---------------------|--|---|----------------------------|---------------------|------|
| Mutual of Omaha Cos. Global Funding | 5,800 | \$ 50 | 0,05 | Wells Fargo & Co. | \$ 100 | \$ 95 | 0,09 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | \$ 191 | \$ 127 | 0,13 | |
| Netflix, Inc. | 4,875 | 1 100 | 1,11 | 4,897 % éch. 25/07/2033 | 1 100 | 1 072 | 1,07 | Residential Accredit Loans, Inc. Trust | 2 | 2 | 0,00 | |
| Newell Brands, Inc. | 4,875 | 271 | 0,27 | Weyerhaeuser Co. | 500 | 476 | 0,48 | 5,065 % éch. 25/07/2035 | 15 | 13 | 0,01 | |
| Newfold Digital Holdings Group, Inc. | 11,750 | 100 | 0,11 | 4,000 % éch. 15/04/2030 | 1 125 | 928 | 0,93 | 5,184 % éch. 25/12/2035 | 19 | 15 | 0,02 | |
| NextEra Energy Operating Partners LP | 7,250 | 100 | 0,10 | 4,000 % éch. 09/03/2052 | 99 | 115 | 0,11 | 5,500 % éch. 25/08/2035 | 497 | 355 | 0,36 | |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC | 2,450 | 500 | 0,43 | 7,375 % éch. 15/03/2032 | 500 | 431 | 0,43 | 6,220 % éch. 25/11/2036 | 227 | 72 | 0,07 | |
| OneMain Finance Corp. | 7,875 | 300 | 0,31 | Zoetis, Inc. | 2,000 | 51 413 | 51,38 | Residential Asset Securitization Trust | 322 | 135 | 0,14 | |
| ONEOK, Inc. | 5,550 | 500 | 0,51 | 2,000 % éch. 15/05/2030 | 500 | 480 | 0,48 | 6,250 % éch. 25/11/2036 | 480 | 180 | 0,18 | |
| Oracle Corp. | 2,300 | 220 | 0,20 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | 73 | 63 | 0,06 | |
| Pacific Gas & Electric Co. | 2,500 | 200 | 0,16 | Al Aqua Merger Sub, Inc. | 400 | 402 | 0,40 | 5,950 % éch. 25/05/2037 | 1 178 | 949 | 0,95 | |
| Pacific Gas & Electric Co. | 3,950 | 425 | 0,31 | TBD % éch. 31/07/2028 | 400 | 402 | 0,40 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | 6 793 | 6 79 | 6,79 | |
| Pacific Gas & Electric Co. | 4,550 | 100 | 0,09 | BCPE Empire Holdings, Inc. | 500 | 502 | 0,50 | 5,500 % éch. 25/05/2035 | 23 794 | 23 78 | 23,78 | |
| PennyMac Financial Services, Inc. | 7,875 | 200 | 0,21 | Charter Communications Operating LLC | 7 360 | 200 | 0,20 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | |
| Plains All American Pipeline LP | 4,500 | 800 | 0,79 | Cloud Software Group, Inc. | 9 877 % - 9,990 % éch. 30/03/2029 | 500 | 490 | 0,49 | Freddie Mac | 631 | 396 | 0,40 |
| PRA Health Sciences, Inc. | 2,875 | 300 | 0,28 | LifePoint Health, Inc. | 11,168 % éch. 16/11/2028 | 500 | 499 | 0,50 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | 94 | 83 | 0,08 |
| Principal Life Global Funding | 1,250 | 200 | 0,18 | Mauser Packaging Solutions Holding Co. | 9,343 % éch. 14/08/2026 | 500 | 503 | 0,51 | 4,000 % éch. 01/08/2052 | 395 | 374 | 0,37 |
| Rexford Industrial Realty LP | 2,125 | 200 | 0,16 | Olympus Water U.S. Holding Corp. | 10,348 % éch. 09/11/2028 | 499 | 502 | 0,50 | 4,500 % éch. 01/09/2052 | 993 | 963 | 0,96 |
| RGA Global Funding | 6,000 | 100 | 0,10 | Trident TPI Holdings, Inc. | 9,848 % éch. 15/09/2028 | 199 | 200 | 0,20 | 5,000 % éch. 01/09/2053 | 985 | 982 | 0,98 |
| Rocket Mortgage LLC | 2,875 | 550 | 0,51 | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | 3 700 | 3 589 | 3,59 | |
| SBA Communications Corp. | 3,125 | 200 | 0,18 | Banc of America Funding Trust | 6,000 % éch. 25/07/2037 | 180 | 143 | 0,14 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 300 | 297 | 0,30 |
| Sealed Air Corp. | 1,573 | 450 | 0,41 | BCAP LLC Trust | 5,910 % éch. 25/05/2047 | 148 | 140 | 0,14 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 2 300 | 2 311 | 2,31 |
| Silgan Holdings, Inc. | 1,400 | 300 | 0,27 | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | 4,213 % éch. 25/07/2036 | 44 | 39 | 0,04 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 6 400 | 6 499 | 6,50 |
| SLM Corp. | 3,125 | 725 | 0,68 | Countrywide Alternative Loan Trust | 4,756 % éch. 25/07/2035 | 136 | 127 | 0,13 | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 8 100 | 8 300 | 8,29 |
| Spirit AeroSystems, Inc. | 9,750 | 100 | 0,11 | 5,500 % éch. 25/10/2035 | 268 | 148 | 0,15 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | |
| Tallgrass Energy Partners LP | 6,000 | 100 | 0,09 | 5,662 % éch. 20/09/2046 | 6 | 6 | 0,01 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) | 518 | 509 | 0,51 | |
| Time Warner Cable Enterprises LLC | 8,375 | 100 | 0,12 | 5,850 % éch. 25/09/2046 | 4 | 4 | 0,00 | 0,125 % éch. 15/07/2024 (i) | 119 | 115 | 0,11 | |
| Travel + Leisure Co. | 6,625 | 75 | 0,08 | 6,000 % éch. 25/10/2035 | 11 | 8 | 0,01 | 0,125 % éch. 15/04/2025 | 130 | 126 | 0,13 | |
| United Airlines Pass-Through Trust | 4,150 | 48 | 0,05 | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 109 | 81 | 0,08 | 0,250 % éch. 15/01/2025 | 2 800 | 2 462 | 2,46 | |
| United Airlines, Inc. | 4,375 | 250 | 0,24 | 6,412 % éch. 25/08/2035 | 10 | 9 | 0,01 | Billets du Trésor américain | 3 212 | 3 21 | 3,21 | |
| United Rentals North America, Inc. | 3,875 | 800 | 0,76 | 6,500 % éch. 25/08/2037 | 1 884 | 805 | 0,80 | 0,500 % éch. 31/10/2027 (i) | 2 462 | 2 46 | 2,46 | |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC | 3,875 | 1 675 | 1,52 | 6,518 % éch. 25/09/2037 | 286 | 256 | 0,26 | ACTIONS | | | | |
| VICI Properties LP | 3,875 | 700 | 0,64 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | 3,862 % éch. 25/09/2037 | 36 | 32 | 0,03 | Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060 | 753 | 0 | 0,00 |
| Vistra Operations Co. LLC | 3,550 | 300 | 0,25 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | 5,750 % éch. 25/07/2037 | 7 | 3 | 0,00 | Vistra Corp. - Exp. 02/02/2024 | 31 815 | 0 | 0,00 |
| Vornado Realty LP | 2,150 | 275 | 0,25 | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates | 6,000 % éch. 25/09/2035 | 229 | 69 | 0,07 | BONS DE SOUSCRIPTION | | | |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 3,200 | 200 | 0,18 | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust | 3,945 % éch. 29/12/2037 | 633 | 342 | 0,34 | Vistra Corp. - Exp. 02/02/2024 | 0 | 0,00 | |
| Warnermedia Holdings, Inc. | 4,279 | 600 | 0,55 | 6,000 % éch. 25/07/2036 | 141 | 70 | 0,07 | Total États-Unis | 95 288 | 95,23 | 95,23 | |
| | | | | 6,500 % éch. 25/10/2021 | 160 | 10 | 0,01 | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | | |
| | | | | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust | 5,610 % éch. 25/07/2047 | 13 | 12 | 0,01 | ILES VIERGES BRITANNIQUES | | | |
| | | | | 5,620 % éch. 25/02/2047 | 3 009 | 1 754 | 1,75 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| | | | | 5,850 % éch. 25/10/2036 | 168 | 49 | 0,05 | Studio City Finance Ltd. | 75 | 63 | 0,06 | |
| | | | | Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust | 3,702 % éch. 25/08/2035 | 11 | 10 | 0,01 | 5,000 % éch. 15/01/2029 | \$ 75 | 63 | 0,06 |
| | | | | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust | 4,594 % éch. 25/08/2035 | 4 | 4 | 0,00 | Total des Valeurs mobilières \$ 120 305 120,23 | | | |
| | | | | Impac Secured Assets Trust | 5,770 % éch. 25/11/2036 | 11 | 11 | 0,01 | ACTIONS | | | |
| | | | | IndyMac Mortgage Loan Trust | 3,669 % éch. 25/05/2037 | 56 | 45 | 0,05 | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| | | | | JP Morgan Mortgage Trust | 3,766 % éch. 25/12/2034 | 232 | 217 | 0,22 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | 309 298 | 3 082 | 3,08 |
| | | | | Lehman XS Trust | 5,970 % éch. 25/02/2037 | 21 | 13 | 0,01 | PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (f) | 9 239 | 126 | 0,12 |
| | | | | 6,370 % éch. 25/08/2047 | 172 | 143 | 0,14 | 3 208 3,20 | | | | |
| | | | | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | |
| | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f) | 4 000 | 399 | 0,40 | Total des Fonds d'investissement \$ 3 607 3,60 | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-----------------------------|------------------|--|--|---------------------|
| SSB | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 737 | Billets du Trésor américain | \$ (752) | \$ 737 | \$ 737 | 0,74 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (752) | \$ 737 | \$ 737 | 0,74 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2024 | 50 | \$ 340 | 0,34 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 3 | (14) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 1 | (10) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 12 | (49) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 61 | (351) | (0,35) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 52 | (481) | (0,48) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 13 | (151) | (0,15) |
| | | | | \$ (716) | (0,72) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (716) | (0,72) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AutoZone, Inc. | (1,000) % | 20/06/2024 | \$ 1 400 | \$ 31 | 0,03 |
| ConocoPhillips | (1,000) | 20/12/2024 | 100 | (1) | 0,00 |
| Johnson Controls International PLC | (1,000) | 20/12/2024 | 1 500 | 42 | 0,04 |
| Tyson Foods, Inc. | (1,000) | 20/06/2024 | 1 400 | 35 | 0,04 |
| | | | | \$ 107 | 0,11 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2027 | \$ 100 | \$ 2 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 100 | 2 | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | 100 | (1) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/06/2025 | € 100 | 21 | 0,02 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2025 | 200 | 20 | 0,02 |
| T-Mobile USA, Inc. | 5,000 | 20/06/2028 | \$ 300 | 3 | 0,00 |
| Toll Brothers Finance Corp. | 1,000 | 20/06/2026 | 200 | 4 | 0,01 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 100 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 52 | 0,05 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 2 700 | \$ (20) | (0,02) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 100 | \$ (17) | (0,02) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 100 | (10) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/09/2027 | ¥ 94 200 | 9 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 20/09/2043 | 40 000 | 9 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,060 | 27/10/2053 | \$ 1 500 | 353 | 0,35 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 % | 20/06/2029 | \$ 3 500 | \$ (3) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 100 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 100 | (6) | (0,01) |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | CAD 3 600 | 41 | 0,04 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,300 | 28/04/2027 | ZAR 15 500 | 13 | 0,01 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | AUD 1 000 | 24 | 0,02 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | 100 | 4 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,000 | 17/03/2053 | € 440 | 199 | 0,20 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 400 | (63) | (0,06) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 100 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 100 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 100 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 100 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,970 | 15/12/2033 | 100 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 100 | (5) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 100 | (3) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 200 | (8) | (0,01) |
| | | | | | \$ 520 | 0,52 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 659 | 0,66 |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------|--------------|---------------------|
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,975 % | 29/05/2024 | 1 200 | \$ 1 | \$ 0 | 0,00 |

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 % | 16/01/2024 | 100 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,195 | 29/05/2024 | 600 | (1) | (2) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 100 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 100 | (1) | (2) | (0,01) |

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 % | 08/01/2024 | 100 | \$ (1) | \$ 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (13) | \$ (16) | (0,02) |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | \$ 97,891 | 09/01/2024 | 100 | \$ 0 | \$ (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % éch. 01/02/2054 | 101,094 | 06/02/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | 95,813 | 06/02/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | 97,813 | 06/02/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | \$ (2) | \$ (3) | 0,00 |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC | Pertamina Persero PT | 1,000 % | 20/12/2024 | \$ 100 | \$ 0 | \$ 1 | \$ 1 | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--|----------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS | À recevoir | Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | S/O | 1,113 % | \$ 4 800 | 20/03/2024 | \$ 59 | \$ (425) | \$ (366) | (0,37) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BOA | 03/2024 | \$ 39 | INR 3 223 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 651 | \$ 718 | 4 | (5) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 161 | 205 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 447 | ¥ 65 800 | 20 | 0 | 20 | 0,02 |
| | 01/2024 | ZAR 11 028 | \$ 595 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ 47 | BRL 231 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 109 | CNH 791 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 15 | IDR 229 327 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 134 | INR 11 195 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 02/2024 | 12 | TRY 358 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | 137 | 4 385 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | MXN 10 467 | \$ 588 | 0 | (27) | (27) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 42 | NOK 446 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 3 990 | \$ 210 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ 144 | BRL 728 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | MXN 4 077 | \$ 234 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 449 | MXN 7 871 | 14 | 0 | 14 | 0,02 |
| | 01/2024 | 77 | ZAR 1 407 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 2 872 | \$ 151 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 29 | IDR 438 856 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 03/2024 | CNH 791 | \$ 110 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 13 | IDR 201 201 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 40 | INR 3 355 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | CAD 949 | \$ 701 | 0 | (19) | (19) | (0,02) |
| | 01/2024 | € 147 | 159 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 237 | AUD 358 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR 2 216 | \$ 116 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 16 | IDR 245 080 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | CAD 91 | \$ 69 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 4 191 | 4 607 | 0 | (24) | (24) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 5 | € 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 206 | IDR 3 172 202 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 04/2024 | 1 | MXN 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | ZAR 3 867 | \$ 204 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 13 | IDR 200 696 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | \$ | 87 | INR 7 305 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 193 | THB 6 659 | 4 | 0 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | £ | 920 | \$ 1 164 | 0 | (9) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 187 | NOK 1 997 | 9 | 0 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR | 5 687 | \$ 298 | 0 | (13) | (0,01) |
| | | | | | \$ 69 | \$ (145) | (0,08) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ | 158 | CHF 138 | \$ 6 | \$ 0 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | | 144 | 125 | 5 | 0 | 0,01 |
| DUB | 01/2024 | CHF | 1 180 | \$ 1 354 | 0 | (49) | (0,05) |
| GLM | 01/2024 | \$ | 4 810 | CHF 4 215 | 201 | 0 | 0,20 |
| MYI | 01/2024 | | 4 838 | 4 224 | 182 | 0 | 0,19 |
| SCX | 01/2024 | | 115 | 100 | 4 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | | 4 790 | 4 180 | 179 | 0 | 0,18 |
| | | | | | \$ 577 | \$ (49) | 0,54 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € | 34 | \$ 38 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 444 | € 405 | 4 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | | 242 | 218 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | | 9 438 | 8 585 | 47 | 0 | 0,05 |
| MYI | 01/2024 | | 9 248 | 8 414 | 49 | 0 | 0,05 |
| UAG | 01/2024 | | 9 209 | 8 372 | 41 | 0 | 0,04 |
| | | | | | \$ 141 | \$ 0 | 0,14 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 209 0,21

Total des Investissements

\$ 124 801 124,72

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (24 738) (24,72)

Actifs nets

\$ 100 063 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

- * Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 1,99 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » | 10/06/2022 | \$ 63 | \$ 63 | 0,06 |
| Intelsat Emergence S.A. | 12/11/2019 | 750 | 214 | 0,21 |
| Oracle Corp, 2,300 % éch. 25/03/2028 | 04/10/2023 | 191 | 201 | 0,20 |
| | | \$ 1 004 | \$ 478 | 0,47 |

- (i) Des titres d'une juste valeur globale de 2 971 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 360 \$ (31 décembre 2022 : 1 243 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 270 \$ (31 décembre 2022 : 290 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 118 444 | \$ 1 861 | \$ 120 305 |
| Fonds d'investissement | 3 208 | 399 | 0 | 3 607 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 737 | 0 | 737 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (24) | 176 | 0 | 152 |
| Totaux | \$ 3 184 | \$ 119 756 | \$ 1 861 | \$ 124 801 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 8 | \$ 79 539 | \$ 648 | \$ 80 195 |
| Fonds d'investissement | 9 253 | 396 | 0 | 9 649 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 6 910 | 0 | 6 910 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 33 | 393 | 0 | 426 |
| Totaux | \$ 9 294 | \$ 87 238 | \$ 648 | \$ 97 180 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| GRE | 5,520 % | 14/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (2 934) | \$ (2 942) | (2,94) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (2 942) | (2,94) |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O | (14) | 0 | (14) |
| BOA | (2) | 0 | (2) | (104) | 0 | (104) |
| BPS | (349) | 270 | (79) | (290) | 290 | 0 |
| BRC | 5 | 0 | 5 | 5 | 0 | 5 |
| CBK | (23) | 0 | (23) | 555 | (550) | 5 |
| DUB | (49) | 0 | (49) | 4 | (40) | (36) |
| GLM | 196 | 0 | 196 | (23) | 0 | (23) |
| GST | (1) | 0 | (1) | 9 | 0 | 9 |
| JPM | (5) | 0 | (5) | (63) | 0 | (63) |
| MBC | 26 | 0 | 26 | 120 | 0 | 120 |
| MYC | (3) | 0 | (3) | (5) | 0 | (5) |
| MYI | 207 | (260) | (53) | 4 | 0 | 4 |
| RBC | S/O | S/O | S/O | 3 | 0 | 3 |
| SAL | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 1 | 0 | 1 | 253 | 0 | 253 |
| UAG | 207 | (260) | (53) | (8) | 0 | (8) |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 52,54 | 40,41 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 66,59 | 40,99 |
| Autres valeurs mobilières | 1,10 | 1,15 |
| Fonds d'investissement | 3,60 | 9,93 |
| Contrats de mise en pension | 0,74 | 7,11 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,72) | 0,41 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,66 | (0,43) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,21 | 0,46 |
| Contrats de prise en pension | (2,94) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Argentine | 0,28 | 0,24 |
| Australie | 0,96 | 0,90 |
| Bermudes | 0,67 | S/O |
| Brésil | S/O | 0,41 |
| Canada | 0,58 | 0,94 |
| Îles Caïmans | 4,87 | 0,64 |
| Chine | 0,00 | 0,02 |
| République tchèque | 0,53 | S/O |
| France | 1,40 | 1,06 |
| Irlande | 1,13 | S/O |
| Italie | 2,41 | 0,34 |
| Japon | S/O | 0,80 |
| Libéria | 0,48 | S/O |
| Luxembourg | 1,13 | 1,17 |
| Mexique | 0,50 | S/O |
| Multinationales | 0,39 | 1,02 |
| Pays-Bas | 0,93 | 0,95 |
| Panama | 1,02 | S/O |
| Pérou | S/O | 0,74 |
| Qatar | S/O | 0,40 |
| Afrique du Sud | 1,53 | 1,71 |
| Espagne | 0,41 | 0,37 |
| Suisse | 1,61 | 1,08 |
| Royaume-Uni | 4,11 | 3,36 |
| États-Unis | 95,23 | 65,91 |
| Îles Vierges britanniques | 0,06 | 0,23 |
| Instruments à court terme | S/O | 0,26 |
| Fonds d'investissement | 3,60 | 9,93 |
| Contrats de mise en pension | 0,74 | 7,11 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,72) | 0,41 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,11 | 0,08 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,05 | 0,04 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,02) | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,52 | (0,55) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,00 | 0,63 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (1,06) |
| Options sur titres | 0,00 | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,03 |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,37) | (0,16) |
| Contrats de change à terme | (0,08) | (0,04) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,68 | 1,08 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (24,72) | (0,03) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | ALBANIE | | | | CHILI | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ILES CAÏMANS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement albanais | | | | 4,850 % éch. 17/04/2028 | \$ 200 | 197 | 0,00 | 7,000 % éch. 30/09/2029 | \$ 18 690 | \$ 1 015 | 0,01 |
| 3,500 % éch. 16/06/2027 | € 16 800 | \$ 17 963 | 0,24 | goeasy Ltd. | | | | 7,250 % éch. 30/09/2030 | 8 779 | 344 | 0,00 |
| ANGOLA | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | Total Îles Caimans | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | | Total Chili | | | |
| Obligation internationale du gouvernement angolais | | | | 6,805 % éch. 16/01/2030 | 842 | 841 | 0,01 | 6,064 % éch. 28/07/2038 | £ 3 700 | 3 797 | 0,05 |
| 8,000 % éch. 26/11/2029 | \$ 7 600 | 6 771 | 0,09 | Catamaran CLO Ltd. | | | | Wynn Macau Ltd. | | | |
| 9,125 % éch. 26/11/2049 | 9 900 | 8 106 | 0,11 | 6,774 % éch. 22/04/2030 | 3 038 | 3 038 | 0,04 | 4,875 % éch. 01/10/2024 | \$ 300 | 296 | 0,00 |
| Total Angola | | 14 877 | 0,20 | CIFC Funding Ltd. | | | | 5,500 % éch. 15/01/2026 | 3 900 | 3 810 | 0,05 |
| ARGENTINE | | | | Venture CLO Ltd. | | | | Total Îles Caimans | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 6,631 % éch. 07/09/2030 | | | | Total Chili | | | |
| Obligation internationale du gouvernement argentin | | | | 6,777 % éch. 20/01/2029 | 3 310 | 3 311 | 0,04 | 5,625 % éch. 26/08/2028 | 1 700 | 1 576 | 0,02 |
| 3,500 % éch. 09/07/2041 | 133 299 | 45 537 | 0,61 | Vibrant CLO Ltd. | | | | | | | |
| 3,625 % éch. 09/07/2035 | 16 928 | 5 773 | 0,08 | 6,717 % éch. 15/09/2030 | 1 235 | 1 232 | 0,02 | | | | |
| Total Argentine | | 51 310 | 0,69 | | | 38 510 | 0,51 | | | | |
| AUSTRALIE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | | CHINE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Sunac China Holdings Ltd. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| CIMIC Finance Ltd. | | | | 1,000 % éch. 30/09/2032 | 5 379 | 417 | 0,01 | Yango Justice International Ltd. | | | |
| 1,500 % éch. 28/05/2029 | € 100 | 96 | 0,00 | Avolon Holdings Funding Ltd. | | | | 7,500 % éch. 15/04/2024 ^ | 28 200 | 155 | 0,00 |
| Pacific National Finance Pty. Ltd. | | | | 2,528 % éch. 18/11/2027 | 12 810 | 11 361 | 0,15 | 7,500 % éch. 17/02/2025 ^ | 19 100 | 191 | 0,01 |
| 4,750 % éch. 22/03/2028 | \$ 1 000 | 938 | 0,01 | 2,875 % éch. 15/02/2025 | 6 800 | 6 564 | 0,09 | 7,875 % éch. 04/09/2024 ^ | 19 800 | 109 | 0,00 |
| Santos Finance Ltd. | | | | 3,250 % éch. 15/02/2027 | 4 900 | 4 536 | 0,06 | Total Chine | | 455 | 0,01 |
| 3,649 % éch. 29/04/2031 | 3 200 | 2 789 | 0,04 | 4,250 % éch. 15/04/2026 | 3 600 | 3 480 | 0,05 | COLOMBIE | | | |
| 6,875 % éch. 19/09/2033 | 2 200 | 2 335 | 0,03 | 5,250 % éch. 15/05/2024 | 1 200 | 1 194 | 0,02 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Woodside Finance Ltd. | | | | 5,500 % éch. 15/01/2026 | 10 500 | 10 439 | 0,14 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 3,700 % éch. 15/09/2026 | 600 | 577 | 0,01 | Diamond Foreign Asset Co. | | | | Obligation internationale du gouvernement colombien | | | |
| 4,500 % éch. 04/03/2029 | 2 200 | 2 116 | 0,03 | 8,500 % éch. 01/10/2030 | 6 000 | 6 141 | 0,08 | 4,500 % éch. 15/03/2029 | 12 100 | 11 368 | 0,15 |
| Total Australie | | 8 851 | 0,12 | Gaci First Investment Co. | | | | 5,000 % éch. 15/06/2045 | 49 920 | 38 906 | 0,53 |
| BERMUDES | | | | Kaisa Group Holdings Ltd. | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 9,375 % éch. 30/06/2024 ^ | | | | Obligation internationale du gouvernement colombien | | | |
| Aircastle Ltd. | | | | 9,750 % éch. 28/09/2023 ^ | 22 900 | 836 | 0,01 | 4,500 % éch. 15/06/2045 | 49 920 | 38 906 | 0,53 |
| 2,850 % éch. 26/01/2028 | 9 900 | 8 842 | 0,12 | 10,500 % éch. 15/01/2025 ^ | 21 600 | 788 | 0,01 | 5,625 % éch. 26/02/2044 | 3 100 | 2 616 | 0,04 |
| 4,250 % éch. 15/06/2026 | 1 600 | 1 547 | 0,02 | 10,875 % éch. 23/07/2023 ^ | 5 800 | 188 | 0,00 | 8,000 % éch. 14/11/2035 | 4 200 | 4 603 | 0,06 |
| 5,250 % éch. 11/08/2025 | 32 800 | 32 351 | 0,44 | 11,250 % éch. 16/04/2025 ^ | 17 000 | 552 | 0,01 | | | | |
| Bacardi Ltd. | | | | 11,500 % éch. 30/01/2023 ^ | 900 | 31 | 0,00 | Total Colombie | | 57 651 | 0,78 |
| 4,700 % éch. 15/05/2028 | 22 840 | 22 399 | 0,30 | 11,650 % éch. 01/06/2026 ^ | 9 300 | 314 | 0,00 | COSTA RICA | | | |
| NCL Corp. Ltd. | | | | 11,700 % éch. 11/11/2025 ^ | 5 750 | 207 | 0,00 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 8,125 % éch. 15/01/2029 | 4 300 | 4 495 | 0,06 | 11,950 % éch. 12/11/2023 ^ | 4 400 | 159 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement costaricain | | | |
| 8,375 % éch. 01/02/2028 | 1 000 | 1 060 | 0,02 | Lima Metro Line Finance Ltd. | | | | 7,300 % éch. 13/11/2054 | 5 100 | 5 546 | 0,07 |
| Seadrill Finance Ltd. | | | | 5,875 % éch. 05/07/2034 | 2 621 | 2 596 | 0,04 | CHYPRE | | | |
| 8,375 % éch. 01/08/2030 | 7 400 | 7 727 | 0,10 | Melco Resorts Finance Ltd. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Valaris Ltd. | | | | 4,875 % éch. 06/06/2025 | 3 400 | 3 301 | 0,04 | Atrium Finance PLC | | | |
| 8,375 % éch. 30/04/2030 | 6 100 | 6 255 | 0,08 | 5,375 % éch. 04/12/2029 | 8 900 | 7 875 | 0,11 | 2,625 % éch. 05/09/2027 | € 9 900 | 8 535 | 0,11 |
| Total Bermudes | | 84 676 | 1,14 | 5,750 % éch. 21/07/2028 | 1 000 | 927 | 0,01 | DANEMARK | | | |
| BRÉSIL | | | | MGM China Holdings Ltd. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,750 % éch. 01/02/2027 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banco do Brasil S.A. | | | | Park Aerospace Holdings Ltd. | | | | TDC Net A/S | | | |
| 8,500 % éch. 29/07/2026 | MXN 89 000 | 4 946 | 0,06 | 5,500 % éch. 15/02/2024 | 504 | 503 | 0,01 | 5,056 % éch. 31/05/2028 | 12 000 | 13 802 | 0,19 |
| Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. | | | | Sands China Ltd. | | | | RÉPUBLIQUE DOMINICAINE | | | |
| 0,000 % éch. 29/01/2024 (d)(f) | \$ 13 194 | 453 | 0,01 | 3,100 % éch. 08/03/2029 | 500 | 436 | 0,01 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Total Brésil | | 5 399 | 0,07 | Seagate HDD Cayman | | | | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | | | |
| CANADA | | | | Suci Second Investment Co. | | | | ÉQUATEUR | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,000 % éch. 25/10/2028 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Air Canada Pass-Through Trust | | | | 6,000 % éch. 25/10/2028 | 13 300 | 14 072 | 0,19 | Obligation internationale du gouvernement d'Équateur | | | |
| 3,300 % éch. 15/07/2031 | 744 | 669 | 0,01 | Sunac China Holdings Ltd. | | | | 0,000 % éch. 31/07/2030 (d) | 21 275 | 6 138 | 0,08 |
| 4,125 % éch. 15/11/2026 | 1 046 | 1 008 | 0,01 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | 6 230 | 654 | 0,01 | 2,500 % éch. 31/07/2040 | 14 324 | 4 583 | 0,06 |
| 5,250 % éch. 01/10/2030 | 2 803 | 2 751 | 0,03 | 6,250 % éch. 30/09/2027 | 6 230 | 493 | 0,01 | 3,500 % éch. 31/07/2035 | 12 238 | 4 400 | 0,06 |
| B.C. Unlimited Liability Co. | | | | 6,500 % éch. 30/09/2027 | 12 460 | 986 | 0,01 | 6,000 % éch. 31/07/2030 | 29 344 | 13 733 | 0,19 |
| 4,000 % éch. 15/10/2030 | 5 075 | 4 558 | 0,06 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | 18 690 | 849 | 0,01 | Total Équateur | | 28 854 | 0,39 |
| 4,375 % éch. 15/01/2028 | 6 870 | 6 568 | 0,09 | ÉGYPTE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Bausch & Lomb Escrow Corp. | | | | Obligation internationale du gouvernement égyptien | | | | | | | |
| 8,375 % éch. 01/10/2028 | 2 750 | 2 904 | 0,04 | 6,375 % éch. 11/04/2031 | | | | € 20 150 | | | |
| Enbridge, Inc. | | | | | | | | 14 369 | | | |
| 5,700 % éch. 08/03/2033 | 2 000 | 2 080 | 0,03 | | | | | 0,19 | | | |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. | | | | | | | | | | | |
| 2,750 % éch. 29/03/2028 | € 21 750 | \$ 22 969 | 0,31 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 7,500 % éch. 16/02/2061 | \$ 36 675 | \$ 21 536 | 0,29 | INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH | | | | Adagio CLO DAC | | | |
| 8,500 % éch. 31/01/2047 | 9 500 | 5 937 | 0,08 | 2,250 % éch. | | | | 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 5 800 | \$ 6 320 | 0,08 |
| Total Égypte | | 41 842 | 0,56 | 16/01/2027 (j) | 19 000 | 19 427 | 0,26 | Ares European CLO DAC | | | |
| FINLANDE | | | | Volkswagen Bank GmbH | 15 800 | 17 020 | 0,23 | 4,575 % éch. 15/04/2030 | 1 630 | 1 786 | 0,02 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,500 % éch. 31/07/2026 | | | | 4,625 % éch. 15/10/2030 | 1 899 | 2 082 | 0,03 |
| Balder Finland Oyj | | | | ZF Finance GmbH | | | | 4,745 % éch. 15/10/2031 | 9 771 | 10 692 | 0,14 |
| 1,000 % éch. 18/01/2027 | € 200 | 188 | 0,00 | 2,750 % éch. 25/05/2027 | € 16 200 | \$ 17 075 | 0,23 | 4,843 % éch. 20/04/2032 | 500 | 544 | 0,01 |
| 1,000 % éch. 20/01/2029 | 300 | 253 | 0,01 | 3,750 % éch. 21/09/2028 | 32 000 | 34 198 | 0,46 | Armada Euro CLO DAC | | | |
| 1,375 % éch. 24/05/2030 | 4 900 | 3 946 | 0,05 | | | 169 635 | 2,28 | 4,685 % éch. 15/07/2031 | 11 041 | 12 067 | 0,16 |
| 2,000 % éch. 18/01/2031 | 300 | 243 | 0,00 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | Aurium CLO DAC | | | |
| Total Finlande | | 4 630 | 0,06 | SCUR-Alpha 1503 GmbH | | | | 4,695 % éch. 16/01/2031 | 4 789 | 5 233 | 0,07 |
| FRANCE | | | | 10,883 % éch. 29/03/2030 | \$ 2 481 | 2 290 | 0,03 | 4,966 % éch. 23/03/2032 | 10 400 | 11 399 | 0,15 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Total Allemagne | | 171 925 | 2,31 | Avoca CLO DAC | | | |
| Altarea S.C.A. | | | | GHANA | | | | 4,785 % éch. 15/10/2032 | 2 900 | 3 164 | 0,04 |
| 1,750 % éch. 16/01/2030 | 500 | 428 | 0,01 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Bain Capital Euro CLO DAC | | | |
| 1,875 % éch. 17/01/2028 | 600 | 558 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement du Ghana | | | | 4,733 % éch. 20/01/2032 | 5 410 | 5 903 | 0,08 |
| Altareit S.C.A. | | | | 7,750 % éch. 07/04/2029 ^ | 14 200 | 6 242 | 0,08 | Black Diamond CLO DAC | | | |
| 2,875 % éch. 02/07/2025 | 100 | 106 | 0,00 | 8,125 % éch. 26/03/2032 ^ | 4 200 | 1 858 | 0,03 | 4,853 % éch. 20/01/2032 | 1 512 | 1 660 | 0,02 |
| Altice France S.A. | | | | 8,750 % éch. 11/03/2061 ^ | 5 100 | 2 215 | 0,03 | 4,982 % éch. 15/05/2032 | 4 299 | 4 689 | 0,06 |
| 3,375 % éch. 15/01/2028 | 3 100 | 2 727 | 0,04 | 8,950 % éch. 26/03/2051 ^ | 5 600 | 2 433 | 0,03 | Blackrock European CLO DAC | | | |
| 4,000 % éch. | | | | Total Ghana | | 12 748 | 0,17 | 4,585 % éch. 15/10/2031 | 10 704 | 11 640 | 0,16 |
| 15/07/2029 (j) | 10 900 | 9 435 | 0,13 | GUATEMALA | | | | BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | |
| 4,250 % éch. 15/10/2029 | 20 100 | 17 734 | 0,24 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 1,050 % éch. 15/01/2031 | 993 | 1 039 | 0,01 |
| 5,500 % éch. 15/01/2028 | \$ 600 | 495 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement du Guatemala | | | | 4,685 % éch. 15/01/2031 | 7 747 | 8 465 | 0,11 |
| 11,500 % éch. | | | | 7,050 % éch. 04/10/2032 | 14 600 | 15 551 | 0,21 | BNPP AM Euro CLO DAC | | | |
| 01/02/2027 (a)(i) | € 4 870 | 5 420 | 0,07 | GUERNSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | 4,565 % éch. 15/04/2031 | 1 000 | 1 088 | 0,01 |
| BPCE S.A. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Bridgepoint CLO DAC | | | |
| 6,714 % éch. 19/10/2029 | \$ 7 000 | 7 378 | 0,10 | Globalworth Real Estate Investments Ltd. | | | | 5,175 % éch. 15/01/2034 | 1 300 | 1 426 | 0,02 |
| 7,003 % éch. 19/10/2034 | 5 000 | 5 440 | 0,07 | 3,000 % éch. 29/03/2025 | € 16 606 | 16 804 | 0,22 | Cairn CLO DAC | | | |
| CGG S.A. | | | | Sirius Real Estate Ltd. | | | | 4,745 % éch. 15/10/2031 | 8 594 | 9 338 | 0,13 |
| 8,750 % éch. 01/04/2027 | 2 000 | 1 824 | 0,02 | 1,125 % éch. 22/06/2026 | 200 | 200 | 0,00 | Carlyle Euro CLO DAC | | | |
| Électricité de France S.A. | | | | 1,750 % éch. 24/11/2028 | 500 | 460 | 0,01 | 4,632 % éch. 15/08/2030 | 3 886 | 4 254 | 0,06 |
| 4,500 % éch. 21/09/2028 | 5 700 | 5 623 | 0,07 | Total Guernesey, Îles Anglo-normandes | | 17 464 | 0,23 | 4,665 % éch. 15/01/2031 | 11 503 | 12 583 | 0,17 |
| 6,900 % éch. 23/05/2053 | 1 700 | 1 926 | 0,02 | HONG KONG | | | | 4,892 % éch. 15/08/2032 | 4 400 | 4 796 | 0,06 |
| 9,125 % éch. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | |
| 15/03/2033 (f) | 12 400 | 13 875 | 0,19 | Fortune Star BVI Ltd. | | | | 4,752 % éch. 15/11/2031 | 7 436 | 8 101 | 0,11 |
| La Mondiale SAM | | | | 3,950 % éch. 02/10/2026 | 8 300 | 5 861 | 0,08 | CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | |
| 5,050 % éch. | | | | HONGRIE | | | | 4,615 % éch. 15/10/2031 | 13 172 | 14 356 | 0,19 |
| 17/12/2025 (f) | € 12 665 | 14 037 | 0,19 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 4,661 % éch. 27/01/2031 | 1 372 | 1 495 | 0,02 |
| Loxam S.A.S. | | | | Obligation internationale du gouvernement hongrois | | | | 4,725 % éch. 15/04/2032 | 1 322 | 1 447 | 0,02 |
| 2,875 % éch. 15/04/2026 | 1 600 | 1 718 | 0,02 | 5,375 % éch. 12/09/2033 | 20 675 | 24 466 | 0,33 | 4,782 % éch. 15/08/2032 | 2 380 | 2 605 | 0,04 |
| 3,750 % éch. 15/07/2026 | 1 900 | 2 080 | 0,03 | Magyar Export-Import Bank | | | | Dryden Euro CLO DAC | | | |
| 4,500 % éch. 15/02/2027 | 5 500 | 6 084 | 0,08 | 6,000 % éch. 16/05/2029 | 6 000 | 7 051 | 0,09 | 4,625 % éch. 15/04/2033 | 12 734 | 13 862 | 0,19 |
| New Immo Holding S.A. | | | | Total Hongrie | | 31 517 | 0,42 | 4,862 % éch. 15/05/2034 | 14 674 | 15 964 | 0,21 |
| 2,750 % éch. 26/11/2026 | 200 | 203 | 0,00 | INDONÉSIE | | | | Euro-Galaxy CLO DAC | | | |
| Renault S.A. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,589 % éch. 24/04/2034 | 9 590 | 10 408 | 0,14 |
| 2,375 % éch. 25/05/2026 | 18 200 | 19 504 | 0,26 | Pertamina Persero PT | | | | 4,693 % éch. 11/04/2031 | 1 123 | 1 228 | 0,02 |
| TDF Infrastructure SASU | | | | 6,500 % éch. 07/11/2048 | \$ 33 400 | 37 416 | 0,50 | GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC | | | |
| 1,750 % éch. 01/12/2029 | 45 500 | 43 976 | 0,59 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara | | | | 4,893 % éch. 20/01/2032 | 1 700 | 1 859 | 0,02 |
| Ubisoft Entertainment S.A. | | | | 3,000 % éch. 30/06/2030 | 17 600 | 15 706 | 0,21 | Griffith Park CLO DAC | | | |
| 0,878 % éch. | | | | 6,150 % éch. 21/05/2048 | 15 000 | 15 405 | 0,21 | 4,704 % éch. 21/11/2031 | 31 267 | 33 994 | 0,46 |
| 24/11/2027 (j) | 6 000 | 5 657 | 0,08 | | | 68 527 | 0,92 | Harvest CLO DAC | | | |
| Verallia S.A. | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 1,040 % éch. 15/07/2031 | 1 600 | 1 674 | 0,02 |
| 1,875 % éch. 10/11/2031 | 8 100 | 7 885 | 0,11 | Obligation internationale du gouvernement indonésien | | | | 4,566 % éch. 26/06/2030 | 1 786 | 1 952 | 0,03 |
| | | 174 113 | 2,34 | 1,400 % éch. 30/10/2031 | € 4 960 | 4 654 | 0,06 | 4,673 % éch. 20/10/2031 | 18 497 | 20 132 | 0,27 |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | 4,850 % éch. 11/01/2033 | \$ 2 800 | 2 855 | 0,04 | 4,725 % éch. 15/07/2031 | 10 400 | 11 324 | 0,15 |
| Altice France S.A. | | | | 5,650 % éch. 11/01/2053 | 1 100 | 1 214 | 0,02 | 4,815 % éch. 15/01/2032 | 17 600 | 19 194 | 0,26 |
| 9,465 % éch. 15/08/2028 | 3 064 | 3 049 | 0,04 | | | | | Invesco Euro CLO DAC | | | |
| Total France | | 177 162 | 2,38 | IRLANDE | | | | 4,615 % éch. 15/07/2031 | 850 | 924 | 0,01 |
| ALLEMAGNE | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | Jubilee CLO DAC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Accunia European CLO DAC | | | | 4,565 % éch. 15/04/2030 | 3 851 | 4 216 | 0,06 |
| Deutsche Bank AG | | | | 4,895 % éch. 15/10/2030 | 567 | 626 | 0,01 | 4,575 % éch. 15/04/2030 | 1 795 | 1 971 | 0,03 |
| 3,729 % éch. | | | | | | | | 4,615 % éch. 15/04/2031 | 5 850 | 6 341 | 0,09 |
| 14/01/2032 (i) | \$ 2 900 | 2 432 | 0,03 | INTERNATIONALES | | | | Laurelin DAC | | | |
| 3,742 % éch. 07/01/2033 | 1 900 | 1 561 | 0,02 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | 4,713 % éch. 20/10/2031 | 10 356 | 11 327 | 0,15 |
| 5,882 % éch. 08/07/2031 | 37 300 | 36 234 | 0,49 | Project Mercury | | | | Madison Park Euro Funding DAC | | | |
| DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH | | | | 8,127 % éch. 11/08/2030 | € 8 000 | 8 865 | 0,12 | 4,715 % éch. 15/01/2032 | 35 500 | 38 644 | 0,52 |
| 2,500 % éch. 25/01/2027 | € 1 200 | 1 142 | 0,02 | IRLANDE | | | | 4,765 % éch. 15/07/2032 | 5 600 | 6 102 | 0,08 |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | Man GLG Euro CLO DAC | | | |
| 1,625 % éch. 09/07/2024 | 17 200 | 18 756 | 0,25 | Accunia European CLO DAC | | | | 4,615 % éch. 15/12/2031 | 9 880 | 10 789 | 0,15 |
| IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature) | | | | 4,895 % éch. 15/10/2030 | 567 | 626 | 0,01 | 4,775 % éch. 15/10/2032 | 4 965 | 5 418 | 0,07 |
| 3,750 % éch. | | | | | | | | Oak Hill European Credit Partners DAC | | | |
| 15/09/2026 (b) | 19 950 | 21 790 | 0,29 | | | | | 4,723 % éch. 20/01/2032 | 2 006 | 2 194 | 0,03 |
| | | | | | | | | 4,733 % éch. 20/10/2031 | 15 161 | 16 563 | 0,22 |
| | | | | | | | | OCP Euro CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,785 % éch. 15/01/2032 | 2 252 | 2 476 | 0,03 |
| | | | | | | | | 4,882 % éch. 22/09/2034 | 12 700 | 13 829 | 0,19 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| OZLME DAC | | | | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | Greensaif Pipelines Bidco SARL | | | |
| 4,758 % éch. 27/07/2032 | € 1 987 | \$ 2 175 | 0,03 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,129 % éch. 23/02/2038 | \$ 2 900 | 3 028 | 0,04 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | AA Bond Co. Ltd. | | | | 6,510 % éch. 23/02/2042 | 4 700 | 4 977 | 0,07 |
| 4,745 % éch. 15/04/2031 | 5 289 | 5 761 | 0,08 | 5,500 % éch. 31/07/2050 | £ 21 190 | \$ 25 670 | 0,34 | Intelsat Jackson Holdings S.A. | | | |
| 5,015 % éch. 15/10/2031 | 4 547 | 4 966 | 0,07 | 7,375 % éch. 31/07/2050 | 7 300 | 9 323 | 0,13 | 6,500 % éch. 15/03/2030 | 13 710 | 13 094 | 0,18 |
| Palmerston Park CLO DAC | | | | Adient Global Holdings Ltd. | | | | Logicor Financing SARL | | | |
| 4,625 % éch. 18/04/2030 | 748 | 822 | 0,01 | 3,500 % éch. 15/08/2024 | € 687 | 754 | 0,01 | 0,750 % éch. 15/07/2024 | € 1 100 | 1 187 | 0,02 |
| Sculptor European CLO DAC | | | | Corsair International Ltd. | | | | 3,250 % éch. 13/11/2028 | 13 900 | 14 631 | 0,20 |
| 4,755 % éch. 14/01/2032 | 6 700 | 7 295 | 0,10 | 8,802 % éch. 28/01/2027 | 18 800 | 20 767 | 0,28 | Petrorio Luxembourg Trading SARL | | | |
| Segovia European CLO DAC | | | | 9,152 % éch. 28/01/2029 | 8 200 | 9 058 | 0,12 | 6,125 % éch. 09/06/2026 | \$ 3 700 | 3 636 | 0,05 |
| 4,873 % éch. 20/07/2032 | 10 100 | 11 015 | 0,15 | G City Europe Ltd. | | | | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | |
| Tikehau CLO DAC | | | | 4,250 % éch. 11/09/2025 | 19 820 | 20 167 | 0,27 | 5,125 % éch. 29/10/2022 ^ | 3 900 | 234 | 0,00 |
| 4,844 % éch. 04/08/2034 | 9 400 | 10 264 | 0,14 | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. | | | | Tierra Mojada Luxembourg SARL | | | |
| Toro European CLO DAC | | | | 3,250 % éch. 12/11/2025 | 900 | 904 | 0,01 | 5,750 % éch. 01/12/2040 | 21 169 | 19 124 | 0,26 |
| 4,812 % éch. 15/02/2034 | 7 650 | 8 336 | 0,11 | Total Jersey, Îles Anglo-normandes | | 86 643 | 1,16 | TMS Issuer SARL | | | |
| 4,885 % éch. 15/10/2030 | 99 | 109 | 0,00 | | | | | 5,780 % éch. 23/08/2032 | 2 100 | 2 196 | 0,03 |
| 4,908 % éch. 12/01/2032 | 2 500 | 2 740 | 0,04 | | | | | | | 177 601 | 2,39 |
| | | 454 666 | 6,11 | JORDANIE | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | |
| | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Albion Financing SARL | | | |
| | | | | Obligation internationale du gouvernement jordanien | | | | 9,252 % éch. 17/08/2026 | € 6 946 | 7 705 | 0,10 |
| | | | | 7,500 % éch. 13/01/2029 | \$ 4 000 | 4 061 | 0,05 | Total Luxembourg | | 203 344 | 2,73 |
| | | | | KAZAKHSTAN | | | | MACÉDOINE DU NORD | | | |
| | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| | | | | KazMunayGas National Co. JSC | | | | Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du Nord | | | |
| | | | | 5,375 % éch. 24/04/2030 | 1 500 | 1 491 | 0,02 | 2,750 % éch. 18/01/2025 | 1 600 | 1 731 | 0,02 |
| | | | | 5,750 % éch. 19/04/2047 | 3 400 | 2 989 | 0,04 | 3,675 % éch. 03/06/2026 | 5 200 | 5 588 | 0,08 |
| | | | | 6,375 % éch. 24/10/2048 | 6 000 | 5 663 | 0,08 | Total Macédoine du Nord | | 7 319 | 0,10 |
| | | | | Total Kazakhstan | | 10 143 | 0,14 | | | | |
| | | | | | | | | ACTIONS | | | |
| | | | | LUXEMBOURG | | | | MEXIQUE | | | |
| | | | | ACTIONS ORDINAIRES | | | | ACTIONS ORDINAIRES | | | |
| | | | | Corestate Capital Holding S.A. (c)(i) | 3 586 721 | 0 | 0,00 | Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. (c) | 28 925 | 0 | 0,00 |
| | | | | DrillCo Holding Lux S.A. (c) | 25 | 1 | 0,00 | Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (c) | 477 | 0 | 0,00 |
| | | | | DrillCo Holding Lux S.A. (c)(i) | 443 430 | 11 011 | 0,15 | Total Actions ordinaires | | 0 | 0,00 |
| | | | | Intelsat Emergence S.A. (c)(i) | 184 535 | 5 257 | 0,07 | | | | |
| | | | | Total Actions ordinaires | | 16 269 | 0,22 | | | | |
| | | | | | | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | |
| | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) | | | | Petroleos Mexicanos | | | |
| | | | | 8,000 % éch. 31/12/2026 ^ (b) | € 3 057 | 1 769 | 0,02 | 6,350 % éch. 12/02/2048 | \$ 3 800 | 2 416 | 0,03 |
| | | | | | | | | 6,625 % éch. 15/06/2035 | 76 800 | 58 997 | 0,79 |
| | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,625 % éch. 15/06/2038 | 3 900 | 2 755 | 0,04 |
| | | | | Albion Financing SARL | | | | 6,700 % éch. 16/02/2032 | 33 787 | 28 076 | 0,38 |
| | | | | 5,250 % éch. 15/10/2026 | 15 600 | 17 276 | 0,23 | 6,750 % éch. 21/09/2047 | 20 900 | 13 702 | 0,19 |
| | | | | 6,125 % éch. 15/10/2026 | \$ 5 500 | 5 455 | 0,07 | 7,690 % éch. 23/01/2050 | 8 400 | 5 984 | 0,08 |
| | | | | Altice Financing S.A. | | | | | | 111 930 | 1,51 |
| | | | | 5,750 % éch. 15/08/2029 | 26 500 | 23 552 | 0,32 | | | | |
| | | | | Altice France Holding S.A. | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| | | | | 6,000 % éch. 15/02/2028 | 23 300 | 11 212 | 0,15 | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | |
| | | | | Aroundtown S.A. | | | | 3,771 % éch. 24/05/2061 | 7 360 | 5 013 | 0,07 |
| | | | | 5,375 % éch. 21/03/2029 | 14 700 | 12 118 | 0,16 | 4,500 % éch. 31/01/2050 | 26 100 | 21 400 | 0,29 |
| | | | | Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) | | | | 5,750 % éch. 12/10/2110 | 10 000 | 8 987 | 0,12 |
| | | | | 3,000 % éch. 31/12/2026 (b) | 773 | 562 | 0,01 | 6,350 % éch. 09/02/2035 | 15 300 | 16 066 | 0,21 |
| | | | | Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % en numéraire ou 11,000 % de rémunération en nature) | | | | | 51 466 | 0,69 | |
| | | | | 10,000 % éch. 31/12/2026 (b) | € 1 700 | 1 878 | 0,02 | Total Mexique | | 163 396 | 2,20 |
| | | | | Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) | | | | MULTINATIONALES | | | |
| | | | | 8,000 % éch. 31/12/2026 ^ (b) | 7 151 | 4 138 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | CPI Property Group S.A. | | | | Connect Finco SARL | | | |
| | | | | 1,500 % éch. 27/01/2031 | 8 900 | 5 201 | 0,07 | 6,750 % éch. 01/10/2026 | 13 400 | 13 331 | 0,18 |
| | | | | 1,625 % éch. 23/04/2027 | 6 500 | 5 293 | 0,07 | | | | |
| | | | | 1,750 % éch. 14/01/2030 | 7 200 | 4 546 | 0,06 | PAYS-BAS | | | |
| | | | | 2,750 % éch. 22/01/2028 | £ 3 200 | 2 874 | 0,04 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | Cromwell Ereit Lux Finco SARL | | | | ASR Nederland NV | | | |
| | | | | 2,125 % éch. 19/11/2025 | € 600 | 626 | 0,01 | 7,000 % éch. 07/12/2043 | € 1 400 | 1 750 | 0,02 |
| | | | | FORESEA Holding S.A. | | | | Athora Netherlands NV | | | |
| | | | | 7,500 % éch. 15/06/2030 | \$ 4 579 | 4 244 | 0,06 | 7,000 % éch. 19/06/2025 (f)(h) | 4 300 | 4 654 | 0,06 |
| | | | | Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. | | | | Citycon Treasury BV | | | |
| | | | | 4,250 % éch. 06/04/2024 | £ 15 900 | \$ 16 519 | 0,22 | 1,625 % éch. 12/03/2028 | 3 400 | 3 012 | 0,04 |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|--------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| CTP NV | | | | PHILIPPINES | | | | AFRIQUE DU SUD | | | |
| 0,500 % éch. 21/06/2025 | € 1 200 | \$ 1 250 | 0,02 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 1,250 % éch. 21/06/2029 | 200 | 184 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement philippin | | | | AngloGold Ashanti Holdings PLC | | | |
| 1,500 % éch. 27/09/2031 | 1 500 | 1 294 | 0,02 | 5,000 % éch. 17/07/2033 | \$ 2 000 | \$ 2 058 | 0,03 | 3,750 % éch. 01/10/2030 | \$ 2 000 | \$ 1 740 | 0,02 |
| Enel Finance International NV | | | | PORTUGAL | | | | Sasol Financing USA LLC | | | |
| 5,000 % éch. 15/06/2032 | \$ 5 000 | 4 881 | 0,07 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,500 % éch. 27/09/2028 | 8 800 | 8 393 | 0,11 |
| Imperial Brands Finance Netherlands BV | | | | Banco Espirito Santo S.A. | € 200 | 61 | 0,00 | 8,750 % éch. 03/05/2029 | 5 600 | 5 720 | 0,08 |
| 1,750 % éch. 18/03/2033 | € 28 800 | 24 960 | 0,34 | Galp Energia SGPS S.A. | | 12 300 | 13 148 | 0,18 | | | |
| ING Groep NV | | | | 2,000 % éch. 15/01/2026 | | | | Total Portugal | | | |
| 5,750 % éch. 16/11/2026 (f)(h) | \$ 9 000 | 8 409 | 0,11 | | | | | 13 209 | 13 209 | 0,18 | |
| 6,500 % éch. 16/04/2025 (f)(h) | 18 702 | 18 248 | 0,24 | ROUMANIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 6,750 % éch. 16/04/2024 (f)(h) | 14 280 | 14 229 | 0,19 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | |
| NE Property BV | | | | Obligation internationale du gouvernement roumain | | | | 5,650 % éch. 27/09/2047 | 13 700 | 10 993 | 0,15 |
| 3,375 % éch. 14/07/2027 | € 25 250 | 26 405 | 0,35 | 2,000 % éch. 14/04/2033 | 1 500 | 1 244 | 0,02 | Total Afrique du Sud | | | |
| NN Group NV | | | | 2,875 % éch. 13/04/2042 | 8 000 | 6 002 | 0,08 | | | | |
| 4,500 % éch. 15/01/2026 (f) | 17 900 | 19 761 | 0,27 | 5,500 % éch. 18/09/2028 | 4 000 | 4 550 | 0,06 | ESPAGNE | | | |
| Q-Park Holding BV | | | | 6,375 % éch. 18/09/2033 | 16 400 | 19 191 | 0,26 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 3,500 % éch. 01/02/2025 | 33 350 | 35 648 | 0,48 | 6,625 % éch. 27/09/2029 | 14 500 | 17 156 | 0,23 | ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A. | | | |
| Sandoz Finance BV | | | | 7,625 % éch. 17/01/2053 | \$ 3 000 | 3 371 | 0,04 | 1,375 % éch. 17/06/2025 (j) € | 700 | 748 | 0,01 |
| 4,220 % éch. 17/04/2033 | 1 225 | 1 406 | 0,02 | Total Roumanie | | | | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | |
| 4,500 % éch. 17/11/2033 | 2 300 | 2 702 | 0,04 | 51 514 | 0,69 | | 6,000 % éch. 29/03/2024 (f)(h) | 2 800 | 3 091 | 0,04 | |
| Syngenta Finance NV | | | | RUSSIE | | | | 6,000 % éch. 15/01/2026 (f)(h) | 9 200 | 10 124 | 0,14 |
| 4,892 % éch. 24/04/2025 | \$ 19 895 | 19 639 | 0,26 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,138 % éch. 14/09/2028 | \$ 15 800 | 16 241 | 0,22 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV | | | | ALROSA Finance S.A. | | | | Cellnex Finance Co. S.A. | | | |
| 4,375 % éch. 09/05/2030 | € 100 | 104 | 0,00 | 3,100 % éch. 25/06/2027 ^ | 22 400 | 1 344 | 0,02 | 2,000 % éch. 15/09/2032 | € 14 400 | 13 644 | 0,18 |
| 4,500 % éch. 01/03/2025 | 1 808 | 2 001 | 0,03 | 4,650 % éch. 09/04/2024 ^ | 3 200 | 192 | 0,00 | Lorca Telecom Bondco S.A. | | | |
| United Group BV | | | | MMK International Capital DAC | 8 600 | 516 | 0,01 | 4,000 % éch. 18/09/2027 | 1 900 | 2 054 | 0,03 |
| 3,625 % éch. 15/02/2028 | 1 600 | 1 643 | 0,02 | 4,375 % éch. 13/06/2024 ^ | | 2 052 | 0,03 | Total Espagne | | | |
| 5,250 % éch. 01/02/2030 | 4 300 | 4 515 | 0,06 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 45 902 | 45 902 | 0,62 | |
| Volkswagen International Finance NV | | | | Obligation internationale du gouvernement russe | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | |
| 3,500 % éch. 17/06/2025 (f) | 10 100 | 10 864 | 0,15 | 5,250 % éch. 23/06/2047 ^ | 14 200 | 5 041 | 0,07 | Grifols S.A. | | | |
| | | 207 559 | 2,79 | Total Russie | | | | 6,223 % éch. 15/11/2027 | 1 292 | 1 415 | 0,02 |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | ARABIE SAOUDITE | | | | Total Espagne | | | |
| EMF-NL Prime BV | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | SRI LANKA | | | |
| 4,785 % éch. 17/04/2041 | 18 | 19 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement saoudite | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Eurosaïl BV | | | | 3,450 % éch. 02/02/2061 | 34 500 | 24 342 | 0,33 | Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka | | | |
| 5,485 % éch. 17/10/2040 | 22 | 24 | 0,00 | 4,875 % éch. 18/07/2033 | 20 000 | 20 453 | 0,28 | 7,550 % éch. 28/03/2030 ^ | \$ 16 800 | 8 482 | 0,11 |
| | | 43 | 0,00 | 5,000 % éch. 18/01/2053 | 20 000 | 18 885 | 0,25 | 7,850 % éch. 14/03/2029 ^ | 5 800 | 2 929 | 0,04 |
| Total Pays-Bas | | | | Total Arabie saoudite | | | | Total Sri Lanka | | | |
| | | 207 602 | 2,79 | 63 680 | 0,86 | | | 11 411 | 0,15 | | |
| NIGERIA | | | | SÉNÉGAL | | | | SUÈDE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement nigérian | | | | Obligation internationale du gouvernement serbe | | | | Castellum AB | | | |
| 7,625 % éch. 28/11/2047 | \$ 17 700 | 14 089 | 0,19 | 1,650 % éch. 03/03/2033 | 8 900 | 7 297 | 0,10 | 0,750 % éch. 04/09/2026 | € 200 | 200 | 0,00 |
| 7,875 % éch. 16/02/2032 | 23 600 | 21 281 | 0,29 | 6,500 % éch. 26/09/2033 | \$ 9 400 | 9 670 | 0,13 | Sagax AB | | | |
| Total Nigeria | | | | Total Serbie | | | | 2,000 % éch. 17/01/2024 | 119 | 132 | 0,00 |
| | | 35 370 | 0,48 | 16 967 | 0,23 | | | 2,250 % éch. 13/03/2025 | 400 | 430 | 0,01 |
| OMAN | | | | SINGAPOUR | | | | Volvo Car AB | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,250 % éch. 31/05/2028 (j) | 29 900 | 33 400 | 0,45 |
| Obligation internationale du gouvernement omanais | | | | Flex Ltd. | | | | Total Suède | | | |
| 6,750 % éch. 17/01/2048 | 21 300 | 22 340 | 0,30 | 3,750 % éch. 01/02/2026 | 14 000 | 13 557 | 0,18 | 34 162 | 0,46 | | |
| PANAMA | | | | SLOVÉNIE | | | | SUISSE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen | | | | Nova Kreditna Banka Maribor d.d. | | | | UBS Group AG | | | |
| 6,700 % éch. 26/01/2036 | 20 600 | 20 466 | 0,27 | 1,875 % éch. 27/01/2025 | € 8 300 | 9 128 | 0,12 | 3,869 % éch. 12/01/2029 | \$ 700 | 661 | 0,01 |
| 6,853 % éch. 28/03/2054 | 2 000 | 1 876 | 0,03 | Nova Ljubljanska Banka d.d. | | | | 4,125 % éch. 15/04/2026 | 15 100 | 14 754 | 0,20 |
| 6,875 % éch. 31/01/2036 | 5 700 | 5 702 | 0,08 | 3,400 % éch. 05/02/2030 (j) | 7 100 | 6 808 | 0,09 | 4,194 % éch. 01/04/2031 | 1 400 | 1 305 | 0,02 |
| Total Panama | | | | Total Slovénie | | | | 4,703 % éch. 05/08/2027 | 1 200 | 1 183 | 0,01 |
| | | 28 044 | 0,38 | 15 936 | 0,21 | | | 6,442 % éch. 11/08/2028 | 3 200 | 3 325 | 0,04 |
| PÉROU | | | | TURQUIE | | | | 6,537 % éch. 12/08/2033 | 5 500 | 5 873 | 0,08 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Total Suisse | | | |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. | | | | Obligation internationale du gouvernement turc | | | | 27 101 | 0,36 | | |
| 10,100 % éch. 15/12/2043 | PEN 68 400 | 18 639 | 0,25 | 4,875 % éch. 16/04/2043 | 33 067 | 24 232 | 0,32 | UKRAINE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,750 % éch. 11/05/2047 | 58 300 | 45 861 | 0,62 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | | Total Turquie | | | | NPC Ukrenergo | | | |
| 8,750 % éch. 21/11/2033 | \$ 15 000 | 18 924 | 0,26 | 70 093 | 0,94 | | | 6,875 % éch. 09/11/2028 | 1 000 | 272 | 0,00 |
| Total Pérou | | | | | | | | Total Ukraine | | | |
| | | 37 563 | 0,51 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | | 5,620 % éch. 25/03/2037 | \$ 1 069 | \$ 360 | 0,01 | Structured Asset Investment Loan Trust | | | |
| 4,470 % éch. 25/01/2037 | \$ 473 | \$ 250 | 0,00 | 5,630 % éch. 25/09/2037 | 753 | 743 | 0,01 | 5,620 % éch. 25/09/2036 | \$ 89 | \$ 87 | 0,00 |
| 4,724 % éch. 25/11/2036 | 7 700 | 7 770 | 0,10 | 5,670 % éch. 25/01/2037 | 1 006 | 355 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/06/2036 | 20 | 19 | 0,00 |
| 5,660 % éch. 25/03/2047 | 302 | 300 | 0,00 | 5,890 % éch. 25/01/2037 | 1 200 | 424 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/01/2036 | 77 | 75 | 0,00 |
| 5,710 % éch. 25/08/2036 | 172 | 169 | 0,00 | 7,345 % éch. 25/03/2035 | 487 | 478 | 0,01 | 6,145 % éch. 25/11/2035 | 7 202 | 6 244 | 0,08 |
| 5,730 % éch. 25/03/2037 | 105 | 102 | 0,00 | Option One Mortgage Loan Trust | | | | 6,235 % éch. 25/08/2035 | 3 913 | 3 753 | 0,05 |
| 5,730 % éch. 25/06/2037 | 45 | 45 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/01/2037 | 147 | 84 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/09/2034 | 43 | 41 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/01/2037 | 43 | 42 | 0,00 | 5,640 % éch. 25/05/2037 | 127 | 68 | 0,00 | 6,400 % éch. 25/01/2035 | 227 | 220 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/03/2037 | 4 349 | 3 998 | 0,05 | 5,650 % éch. 25/04/2037 | 444 | 212 | 0,00 | 6,595 % éch. 25/07/2033 | 20 | 20 | 0,00 |
| 5,875 % éch. 25/07/2036 | 141 | 137 | 0,00 | 5,720 % éch. 25/07/2037 | 2 232 | 1 421 | 0,02 | 6,850 % éch. 25/04/2033 | 11 | 11 | 0,00 |
| Lehman ABS Mortgage Loan Trust | | | | 5,750 % éch. 25/07/2036 | 13 419 | 7 546 | 0,10 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,560 % éch. 25/06/2037 | 241 | 154 | 0,00 | 6,010 % éch. 25/01/2036 | 400 | 364 | 0,01 | 5,700 % éch. 25/01/2037 | 2 025 | 1 204 | 0,02 |
| 5,670 % éch. 25/06/2037 | 123 | 79 | 0,00 | 6,040 % éch. 25/01/2036 | 5 043 | 3 626 | 0,05 | 5,810 % éch. 25/12/2036 | 70 | 65 | 0,00 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | 6,235 % éch. 25/08/2035 | 350 | 335 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/12/2036 | 90 | 88 | 0,00 |
| 5,650 % éch. 25/09/2036 | 14 012 | 3 888 | 0,05 | Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates | | | | 5,890 % éch. 25/02/2037 | 124 | 120 | 0,00 |
| 6,010 % éch. 25/05/2046 | 2 479 | 751 | 0,01 | 6,160 % éch. 25/11/2035 | 384 | 362 | 0,01 | 6,370 % éch. 25/08/2037 | 30 | 29 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 25/02/2036 | 11 128 | 8 920 | 0,12 | Owinit Mortgage Loan Trust | | | | Structured Asset Securities Corp. Trust | | | |
| 6,115 % éch. 25/11/2035 | 20 | 20 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/10/2036 | 122 | 116 | 0,00 | 6,160 % éch. 25/09/2035 | 150 | 140 | 0,00 |
| 6,520 % éch. 25/06/2035 | 249 | 240 | 0,00 | Park Place Securities, Inc. | | | | Truman Capital Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,745 % éch. 25/02/2035 | 1 762 | 1 720 | 0,02 | 6,205 % éch. 25/09/2035 | 164 | 160 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/03/2036 | 300 | 297 | 0,00 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust | | | |
| 5,670 % éch. 25/08/2036 | 4 923 | 1 523 | 0,02 | 6,205 % éch. 25/08/2035 | 316 | 308 | 0,00 | 5,620 % éch. 25/01/2037 | 1 455 | 1 227 | 0,02 |
| 5,690 % éch. 25/08/2036 | 1 888 | 728 | 0,01 | 6,205 % éch. 25/09/2035 | 5 162 | 4 982 | 0,07 | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust | | | |
| 5,740 % éch. 25/08/2036 | 3 260 | 1 285 | 0,02 | 6,265 % éch. 25/07/2035 | 72 | 71 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/05/2036 | 630 | 473 | 0,01 |
| 5,770 % éch. 25/03/2036 | 996 | 900 | 0,01 | 6,295 % éch. 25/07/2035 | 400 | 360 | 0,01 | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 5,830 % éch. 25/02/2036 | 325 | 124 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/10/2034 | 233 | 228 | 0,00 | 5,965 % éch. 25/05/2036 | 1 288 | 1 284 | 0,02 |
| 5,950 % éch. 25/03/2036 | 982 | 603 | 0,01 | 6,595 % éch. 25/03/2035 | 222 | 216 | 0,00 | Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates | | | |
| 6,220 % éch. 25/10/2035 | 280 | 262 | 0,00 | 6,715 % éch. 25/01/2036 | 1 282 | 1 262 | 0,02 | 6,210 % éch. 25/04/2034 | 139 | 134 | 0,00 |
| 6,250 % éch. 25/02/2034 | 435 | 438 | 0,01 | 7,270 % éch. 25/12/2034 | 395 | 389 | 0,01 | | | | |
| 6,370 % éch. 25/04/2034 | 284 | 265 | 0,00 | People's Choice Home Loan Securities Trust | | | | | | | |
| 6,370 % éch. 25/10/2035 | 1 325 | 1 172 | 0,02 | 6,820 % éch. 25/01/2035 | 388 | 372 | 0,01 | | | | |
| MASTR Specialized Loan Trust | | | | People's Financial Realty Mortgage Securities Trust | | | | | | | |
| 6,595 % éch. 25/11/2035 | 133 | 126 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/09/2036 | 981 | 252 | 0,00 | | | | |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust | | | | | | | |
| 4,471 % éch. 25/11/2037 | 2 770 | 973 | 0,01 | 5,680 % éch. 25/01/2037 | 334 | 321 | 0,00 | | | | |
| 5,770 % éch. 25/08/2037 | 2 672 | 1 382 | 0,02 | 5,730 % éch. 25/11/2036 | 0 | 0 | 0,00 | | | | |
| 6,190 % éch. 25/05/2036 | 49 | 48 | 0,00 | 6,055 % éch. 25/02/2036 | 31 | 30 | 0,00 | | | | |
| 6,370 % éch. 25/02/2047 | 103 | 61 | 0,00 | RAAC Trust | | | | | | | |
| 6,520 % éch. 25/04/2035 | 88 | 83 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/06/2044 | 47 | 40 | 0,00 | | | | |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | 6,070 % éch. 25/09/2045 | 72 | 70 | 0,00 | | | | |
| 5,540 % éch. 25/10/2036 | 65 | 28 | 0,00 | 6,170 % éch. 25/11/2046 | 152 | 142 | 0,00 | | | | |
| 5,600 % éch. 25/11/2036 | 297 | 134 | 0,00 | 6,670 % éch. 25/10/2045 | 0 | 0 | 0,00 | | | | |
| 5,600 % éch. 25/01/2037 | 864 | 384 | 0,01 | 6,970 % éch. 25/09/2047 | 388 | 372 | 0,01 | | | | |
| 5,610 % éch. 25/10/2036 | 1 887 | 815 | 0,01 | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | | | | |
| 5,610 % éch. 25/11/2036 | 184 | 86 | 0,00 | 5,340 % éch. 25/01/2037 | 1 247 | 423 | 0,01 | | | | |
| 5,610 % éch. 25/05/2037 | 3 203 | 2 343 | 0,03 | Residential Asset Mortgage Products Trust | | | | | | | |
| 5,620 % éch. 25/10/2036 | 170 | 89 | 0,00 | 6,110 % éch. 25/01/2036 | 388 | 358 | 0,01 | | | | |
| 5,620 % éch. 25/11/2036 | 2 863 | 1 630 | 0,02 | Residential Asset Securities Corp. Trust | | | | | | | |
| 5,670 % éch. 25/09/2036 | 3 | 1 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/11/2036 | 233 | 214 | 0,00 | | | | |
| 5,690 % éch. 25/11/2036 | 230 | 107 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/11/2036 | 62 | 58 | 0,00 | | | | |
| 5,720 % éch. 25/03/2037 | 896 | 384 | 0,01 | 6,030 % éch. 25/04/2036 | 25 | 25 | 0,00 | | | | |
| 5,790 % éch. 25/09/2036 | 1 161 | 497 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/02/2036 | 124 | 122 | 0,00 | | | | |
| 6,050 % éch. 25/01/2035 | 686 | 684 | 0,01 | 6,100 % éch. 25/12/2035 | 41 | 41 | 0,00 | | | | |
| 6,090 % éch. 25/12/2035 | 114 | 110 | 0,00 | 6,130 % éch. 25/11/2035 | 10 | 10 | 0,00 | | | | |
| 6,175 % éch. 25/12/2034 | 78 | 73 | 0,00 | 6,130 % éch. 25/12/2035 | 144 | 128 | 0,00 | | | | |
| 6,175 % éch. 25/01/2035 | 1 380 | 1 330 | 0,02 | 6,310 % éch. 25/12/2034 | 4 | 4 | 0,00 | | | | |
| 6,265 % éch. 25/03/2034 | 569 | 569 | 0,01 | Saxon Asset Securities Trust | | | | | | | |
| 6,325 % éch. 25/03/2034 | 340 | 340 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/05/2047 | 6 212 | 4 347 | 0,06 | | | | |
| 6,340 % éch. 25/09/2035 | 4 318 | 3 512 | 0,05 | 5,870 % éch. 25/09/2047 | 11 523 | 10 529 | 0,14 | | | | |
| 6,460 % éch. 25/06/2035 | 834 | 815 | 0,01 | 5,935 % éch. 25/03/2036 | 1 465 | 1 401 | 0,02 | | | | |
| 6,720 % éch. 25/07/2037 | 400 | 337 | 0,00 | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | | | | | |
| 9,270 % éch. 25/02/2047 | 676 | 551 | 0,01 | 5,650 % éch. 25/07/2036 | 240 | 83 | 0,00 | | | | |
| Morgan Stanley Capital, Inc. Trust | | | | 5,750 % éch. 25/07/2036 | 688 | 563 | 0,01 | | | | |
| 5,830 % éch. 25/03/2036 | 92 | 73 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/03/2036 | 1 215 | 744 | 0,01 | | | | |
| Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust | | | | 5,970 % éch. 25/05/2036 | 248 | 130 | 0,00 | | | | |
| 6,820 % éch. 25/02/2033 | 204 | 206 | 0,00 | 6,010 % éch. 25/03/2036 | 105 | 94 | 0,00 | | | | |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | | 6,130 % éch. 25/08/2035 | 108 | 86 | 0,00 | | | | |
| 5,570 % éch. 25/12/2036 | 1 401 | 680 | 0,01 | SG Mortgage Securities Trust | | | | | | | |
| 5,700 % éch. 25/04/2037 | 2 315 | 1 206 | 0,02 | 5,680 % éch. 25/10/2036 | 1 500 | 1 068 | 0,01 | | | | |
| 5,790 % éch. 25/04/2036 | 66 | 47 | 0,00 | Soundview Home Loan Trust | | | | | | | |
| 5,820 % éch. 25/04/2037 | 15 810 | 8 255 | 0,11 | 5,590 % éch. 25/11/2036 | 33 | 10 | 0,00 | | | | |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | 5,935 % éch. 25/06/2036 | 15 508 | 12 919 | 0,17 | | | | |
| 6,000 % éch. 25/02/2037 | 52 | 29 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/07/2036 | 200 | 174 | 0,00 | | | | |
| 6,000 % éch. 25/04/2037 | 9 877 | 3 514 | 0,05 | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust | | | | | | | |
| 7,049 % éch. 25/11/2036 | 220 | 78 | 0,00 | 4,074 % éch. 25/02/2037 | 477 | 173 | 0,00 | | | | |
| New Century Home Equity Loan Trust | | | | 5,740 % éch. 25/04/2037 | 114 | 79 | 0,00 | | | | |
| 5,830 % éch. 25/05/2036 | 6 | 6 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/11/2037 | 626 | 343 | 0,01 | | | | |
| 6,190 % éch. 25/03/2035 | 167 | 164 | 0,00 | | | | | | | | |
| NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | | | | | | | | |
| 5,570 % éch. 25/03/2037 | 853 | 287 | 0,00 | | | | | | | | |

ACTIONS ORDINAIRES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ENERGIE | | | |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (c)(i) | 844 339 | 91 | 0,00 |

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Alaska Airlines Pass-Through Trust | | | |
| 4,800 % éch. 15/02/2029 | \$ 2 386 | 2 322 | 0,03 |
| Ally Financial, Inc. | | | |
| 8,000 % éch. 01/11/2031 | 12 575 | 13 784 | 0,19 |
| AMC Networks, Inc. | | | |
| 4,250 % éch. 15/02/2029 | 750 | 573 | 0,01 |
| American Airlines Pass-Through Trust | | | |
| 3,000 % éch. 15/04/2030 | 739 | 668 | 0,01 |
| 3,150 % éch. 15/08/2033 | 2 946 | 2 583 | 0,03 |
| 3,200 % éch. 15/12/2029 | 3 575 | 3 260 | 0,04 |
| 3,350 % éch. 15/04/2031 | 2 599 | 2 350 | 0,03 |
| 3,375 % éch. 01/11/2028 | 3 624 | 3 324 | 0,04 |
| 3,575 % éch. 15/07/2029 | 2 134 | 1 992 | 0,03 |
| 3,650 % éch. 15/12/2029 | 4 047 | 3 623 | 0,05 |
| 3,650 % éch. 15/08/2030 | 4 118 | 3 817 | 0,05 |
| 3,700 % éch. 01/04/2028 | 3 380 | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,930 % éch. 01/05/2060 | \$ 10 000 | \$ 10 373 | 0,14 | 4,125 % éch. 17/08/2027 | \$ 6 100 | \$ 5 780 | 0,08 | NuStar Logistics LP | \$ 20 400 | \$ 20 331 | 0,27 |
| Booz Allen Hamilton, Inc. | | | | 4,271 % éch. 09/01/2027 | 1 700 | 1 631 | 0,02 | Occidental Petroleum Corp. | 20 900 | 22 253 | 0,30 |
| 3,875 % éch. 01/09/2028 | 1 200 | 1 132 | 0,02 | 4,389 % éch. 08/01/2026 | 1 800 | 1 751 | 0,02 | 8,875 % éch. 15/07/2030 | 2 915 | 3 415 | 0,05 |
| British Airways Pass-Through Trust | | | | 4,535 % éch. 06/03/2025 | £ 2 800 | 3 520 | 0,05 | Omega Healthcare Investors, Inc. | 200 | 193 | 0,00 |
| 2,900 % éch. 15/09/2036 | 1 202 | 1 031 | 0,01 | 4,542 % éch. 01/08/2026 | \$ 1 900 | 1 841 | 0,02 | 4,750 % éch. 15/01/2028 | | | |
| 4,250 % éch. 15/05/2034 | 2 301 | 2 148 | 0,03 | 5,125 % éch. 16/06/2025 | 1 525 | 1 507 | 0,02 | OneMain Finance Corp. | 11 800 | 11 954 | 0,16 |
| Broadcom, Inc. | | | | 5,584 % éch. 18/03/2024 | 4 600 | 4 594 | 0,06 | 7,125 % éch. 15/03/2026 | 3 458 | 3 525 | 0,05 |
| 2,450 % éch. 15/02/2031 | 8 900 | 7 616 | 0,10 | 7,350 % éch. 04/11/2027 | 1 100 | 1 161 | 0,02 | Organon & Co. | € 41 400 | 42 124 | 0,57 |
| 3,187 % éch. 15/11/2036 | 2 600 | 2 108 | 0,03 | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC | | | | Pacific Gas & Electric Co. | \$ 300 | 271 | 0,00 |
| 4,926 % éch. 15/05/2037 | 1 242 | 1 203 | 0,02 | 5,500 % éch. 01/05/2028 | 19 600 | 18 864 | 0,25 | 2,100 % éch. 01/08/2027 | 1 300 | 1 074 | 0,01 |
| Cantor Fitzgerald LP | | | | 6,500 % éch. 01/10/2025 | 13 461 | 13 430 | 0,18 | 2,500 % éch. 01/02/2031 | 8 400 | 8 060 | 0,11 |
| 7,200 % éch. 12/12/2028 | 4 875 | 5 001 | 0,07 | Freedom Mortgage Corp. | | | | 3,300 % éch. 15/03/2027 | 3 100 | 2 901 | 0,04 |
| Centene Corp. | | | | 6,625 % éch. 15/01/2027 | 13 100 | 12 516 | 0,17 | 3,300 % éch. 01/12/2027 | 2 900 | 2 709 | 0,04 |
| 3,000 % éch. 15/10/2030 | 5 000 | 4 337 | 0,06 | 7,625 % éch. 01/05/2026 | 23 900 | 23 606 | 0,32 | 3,300 % éch. 01/08/2040 | 25 900 | 18 998 | 0,26 |
| 4,625 % éch. 15/12/2029 | 3 500 | 3 360 | 0,05 | General Motors Co. | | | | 3,400 % éch. 15/08/2024 | 1 900 | 1 869 | 0,02 |
| Charter Communications Operating LLC | | | | 6,800 % éch. 01/10/2027 (i) | 700 | 743 | 0,01 | 3,450 % éch. 01/07/2025 | 2 250 | 2 179 | 0,03 |
| 3,850 % éch. 01/04/2061 | 11 300 | 7 052 | 0,09 | Genesis Energy LP | | | | 3,500 % éch. 15/06/2025 | 2 000 | 1 939 | 0,03 |
| 4,200 % éch. 15/03/2028 | 4 300 | 4 134 | 0,06 | 8,875 % éch. 15/04/2030 | 1 400 | 1 449 | 0,02 | 3,750 % éch. 01/07/2028 | 2 350 | 2 203 | 0,03 |
| 5,375 % éch. 01/04/2038 | 3 800 | 3 432 | 0,05 | Global Atlantic Fin Co. | | | | 3,950 % éch. 01/12/2047 | 800 | 587 | 0,01 |
| Chesapeake Energy Corp. | | | | 4,400 % éch. 15/10/2029 | 11 620 | 10 711 | 0,14 | 4,200 % éch. 01/06/2041 | 1 100 | 882 | 0,01 |
| 5,500 % éch. 01/02/2026 | 1 500 | 1 488 | 0,02 | GLP Capital LP | | | | 4,250 % éch. 15/03/2046 | 2 000 | 1 543 | 0,02 |
| Citigroup, Inc. | | | | 5,750 % éch. 01/06/2028 | 3 700 | 3 736 | 0,05 | 4,450 % éch. 15/04/2042 | 3 500 | 2 833 | 0,04 |
| 2,572 % éch. 03/06/2031 (i) | 6 900 | 5 898 | 0,08 | GN Bondco LLC | | | | 4,500 % éch. 01/07/2040 | 9 396 | 7 961 | 0,11 |
| Cloud Software Group, Inc. | | | | 9,500 % éch. 15/10/2031 | 7 700 | 7 528 | 0,10 | 4,600 % éch. 15/06/2043 | 3 600 | 2 972 | 0,04 |
| 6,500 % éch. 31/03/2029 | 4 000 | 3 813 | 0,05 | Goldman Sachs Group, Inc. | | | | 4,650 % éch. 01/08/2028 | 100 | 96 | 0,00 |
| CommScope, Inc. | | | | 2,615 % éch. 22/04/2032 | 5 000 | 4 199 | 0,06 | Plains All American Pipeline LP | | | |
| 4,750 % éch. 01/09/2029 | 9 100 | 6 118 | 0,08 | Gray Oak Pipeline LLC | | | | 5,150 % éch. 01/06/2042 | 12 177 | 11 036 | 0,15 |
| Community Health Systems, Inc. | | | | 3,450 % éch. 15/10/2027 | 6 900 | 6 425 | 0,09 | 6,650 % éch. 15/01/2037 | 6 790 | 7 278 | 0,10 |
| 6,000 % éch. 15/01/2029 | 2 200 | 1 983 | 0,03 | GTCR W-2 Merger Sub LLC | | | | Rio Oil Finance Trust | 1 330 | 1 386 | 0,02 |
| 8,000 % éch. 15/03/2026 | 2 124 | 2 119 | 0,03 | 7,500 % éch. 15/01/2031 | 4 125 | 4 362 | 0,06 | RLJ Lodging Trust LP | | | |
| Coty, Inc. | | | | HAT Holdings LLC | | | | 3,750 % éch. 01/07/2026 | 1 600 | 1 517 | 0,02 |
| 3,875 % éch. 15/04/2026 | € 16 400 | 18 126 | 0,24 | 8,000 % éch. 15/06/2027 | 3 300 | 3 441 | 0,05 | Rockies Express Pipeline LLC | | | |
| Credit Acceptance Corp. | | | | HCA, Inc. | | | | 3,600 % éch. 15/05/2025 | 100 | 97 | 0,00 |
| 9,250 % éch. 15/12/2028 | \$ 5 000 | 5 336 | 0,07 | 3,500 % éch. 15/07/2051 | 5 000 | 3 527 | 0,05 | 4,800 % éch. 15/05/2030 | 14 400 | 13 195 | 0,18 |
| Credit Suisse AG AT1 Claim | | | | 5,500 % éch. 01/06/2033 | 1 600 | 1 626 | 0,02 | 4,950 % éch. 15/07/2029 | 5 000 | 4 787 | 0,06 |
| Crown Castle, Inc. | | | | 5,900 % éch. 01/06/2053 | 1 775 | 1 822 | 0,02 | Sabine Pass Liquefaction LLC | 40 625 | 40 731 | 0,54 |
| 2,100 % éch. 01/04/2031 | 6 500 | 5 298 | 0,07 | IQVIA, Inc. | | | | Santander Holdings USA, Inc. | 7 900 | 7 681 | 0,10 |
| 2,250 % éch. 15/01/2031 | 4 000 | 3 315 | 0,04 | 5,700 % éch. 15/05/2028 | 2 000 | 2 040 | 0,03 | 3,450 % éch. 02/06/2025 | | | |
| 2,500 % éch. 15/07/2031 | 5 000 | 4 173 | 0,06 | JetBlue Pass-Through Trust | | | | Sirius XM Radio, Inc. | 4 300 | 4 044 | 0,05 |
| 5,000 % éch. 11/01/2028 | 6 500 | 6 480 | 0,09 | 2,750 % éch. 15/11/2033 | 817 | 691 | 0,01 | 3,125 % éch. 01/09/2026 | 3 000 | 2 677 | 0,04 |
| CVS Health Corp. | | | | 4,000 % éch. 15/05/2034 | 9 162 | 8 410 | 0,11 | 4,125 % éch. 01/07/2030 | | | |
| 3,250 % éch. 15/08/2029 | 8 330 | 7 767 | 0,10 | JPMorgan Chase & Co. | | | | Sitio Royalties Operating Partnership LP | 2 000 | 2 074 | 0,03 |
| DAE Funding LLC | | | | 4,586 % éch. 26/04/2033 | 5 000 | 4 832 | 0,06 | 7,875 % éch. 01/11/2028 | | | |
| 1,550 % éch. 01/08/2024 | 15 800 | 15 396 | 0,21 | Kennedy-Wilson, Inc. | | | | Spirit AeroSystems, Inc. | 900 | 986 | 0,01 |
| 1,625 % éch. 15/02/2024 | 13 500 | 13 428 | 0,18 | 4,750 % éch. 01/02/2030 | 24 300 | 19 727 | 0,26 | 9,375 % éch. 30/11/2029 | 3 100 | 3 336 | 0,04 |
| 2,625 % éch. 20/03/2025 | 7 700 | 7 395 | 0,10 | Las Vegas Sands Corp. | | | | 9,750 % éch. 15/11/2030 | | | |
| 3,375 % éch. 20/03/2028 | 8 700 | 8 030 | 0,11 | 3,200 % éch. 08/08/2024 | 5 610 | 5 505 | 0,07 | Spirit Airlines Pass-Through Trust | 282 | 259 | 0,00 |
| Dell International LLC | | | | 3,500 % éch. 18/08/2026 | 6 500 | 6 200 | 0,08 | 4,100 % éch. 01/10/2029 | | | |
| 8,100 % éch. 15/07/2036 | 2 337 | 2 877 | 0,04 | 3,900 % éch. 08/08/2029 | 3 100 | 2 860 | 0,04 | Sprint Capital Corp. | 12 000 | 14 825 | 0,20 |
| DISH DBS Corp. | | | | LifePoint Health, Inc. | | | | Sprint LLC | 1 125 | 1 176 | 0,02 |
| 5,750 % éch. 01/12/2028 | 7 100 | 5 676 | 0,08 | 11,000 % éch. 15/10/2030 | 13 350 | 14 076 | 0,19 | 7,625 % éch. 01/03/2026 | | | |
| Edison International | | | | Mariott International, Inc. | | | | Standard Industries, Inc. | € 37 000 | 38 776 | 0,52 |
| 5,750 % éch. 15/06/2027 | 100 | 102 | 0,00 | 4,625 % éch. 15/06/2030 | 900 | 884 | 0,01 | 2,250 % éch. 21/11/2026 | \$ 3 450 | 3 324 | 0,04 |
| EI Paso Natural Gas Co. LLC | | | | Marvell Technology, Inc. | | | | 4,750 % éch. 15/01/2028 | | | |
| 8,375 % éch. 15/06/2032 | 1 000 | 1 168 | 0,02 | 5,750 % éch. 15/02/2029 | 2 300 | 2 378 | 0,03 | Synchrony Financial | 300 | 292 | 0,00 |
| Elevance Health, Inc. | | | | Mattel, Inc. | | | | 5,150 % éch. 19/03/2029 | | | |
| 4,750 % éch. 15/02/2033 | 2 400 | 2 402 | 0,03 | 3,375 % éch. 01/04/2026 | 2 800 | 2 665 | 0,04 | T-Mobile USA, Inc. | 1 000 | 1 014 | 0,01 |
| Energy Transfer LP | | | | McAfee Corp. | | | | 5,650 % éch. 15/01/2053 | 2 000 | 2 084 | 0,03 |
| 4,950 % éch. 15/05/2028 | 14 763 | 14 703 | 0,20 | 7,375 % éch. 15/02/2030 | 2 000 | 1 829 | 0,02 | Tallgrass Energy Partners LP | 3 400 | 3 217 | 0,04 |
| 5,950 % éch. 01/10/2043 | 200 | 198 | 0,00 | Medline Borrower LP | | | | 5,500 % éch. 15/01/2028 | 7 450 | 6 936 | 0,09 |
| 6,050 % éch. 01/06/2041 | 3 811 | 3 841 | 0,05 | 3,875 % éch. 01/04/2029 | 6 000 | 5 432 | 0,07 | 6,000 % éch. 31/12/2030 | | | |
| 6,100 % éch. 15/02/2042 | 800 | 805 | 0,01 | 5,250 % éch. 01/10/2029 | 6 000 | 5 664 | 0,08 | Tennessee Gas Pipeline Co. LLC | 1 351 | 1 577 | 0,02 |
| 6,500 % éch. 01/02/2042 | 7 140 | 7 554 | 0,10 | Midwest Connector Capital Co. LLC | | | | Time Warner Cable LLC | 1 200 | 943 | 0,01 |
| 6,625 % éch. 15/10/2036 | 800 | 863 | 0,01 | 3,900 % éch. 01/04/2024 | 1 300 | 1 293 | 0,02 | 4,500 % éch. 15/09/2042 | 1 700 | 1 688 | 0,02 |
| 7,500 % éch. 01/07/2038 | 12 865 | 14 913 | 0,20 | Morgan Stanley | | | | 6,750 % éch. 15/06/2039 | | | |
| EQT Corp. | | | | 5,250 % éch. 21/04/2034 | 5 000 | 5 002 | 0,07 | TransDigm, Inc. | 7 375 | 7 738 | 0,10 |
| 6,125 % éch. 01/02/2025 | 28 205 | 28 348 | 0,38 | National Fuel Gas Co. | | | | | | | |
| Fidelity National Financial, Inc. | | | | 2,950 % éch. 01/03/2031 | 1 017 | 853 | 0,01 | | | | |
| 3,400 % éch. 15/06/2030 | 200 | 178 | 0,00 | Netflix, Inc. | | | | | | | |
| First Student Bidco, Inc. | | | | 4,875 % éch. 15/06/2030 | 21 000 | 21 285 | 0,29 | | | | |
| 4,000 % éch. 31/07/2029 | 1 400 | 1 215 | 0,02 | NextEra Energy Operating Partners LP | | | | | | | |
| Ford Motor Credit Co. LLC | | | | 7,250 % éch. 15/01/2029 | 2 650 | 2 776 | 0,04 | | | | |
| 2,386 % éch. 17/02/2026 | € 4 200 | 4 516 | 0,06 | NGPL PipeCo LLC | | | | | | | |
| 2,700 % éch. 10/08/2026 | \$ 13 600 | 12 602 | 0,17 | 7,768 % éch. 15/12/2037 | 21 356 | 23 815 | 0,32 | | | | |
| 2,748 % éch. 14/06/2024 | £ 6 500 | 8 176 | 0,11 | Noble Finance LLC | | | | | | | |
| 3,250 % éch. 15/09/2025 | € 4 000 | 4 367 | 0,06 | 8,000 % éch. 15/04/2030 | 3 050 | 3 176 | 0,04 | | | | |
| 3,815 % éch. 02/11/2027 | \$ 1 200 | 1 121 | 0,01 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|--|---|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (g) | | | | |
| 5,000 % éch. 01/01/2054 | \$ 185 800 | \$ 183 843 | 2,47 | BONS DU TRÉSOR ARGENTIN | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 01/02/2054 | 205 600 | 206 532 | 2,78 | (34,368) % éch. | | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 01/02/2054 | 209 900 | 213 139 | 2,86 | 20/05/2024 (d)(e) ARS | 2 067 | \$ 3 | 0,00 | | 34 226 990 \$ | 346 377 | 4,65 | |
| 6,500 % éch. 01/02/2054 | 309 650 | 317 306 | 4,27 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g) | | | | |
| | | 935 984 | 12,58 | 10,900 % éch. | | | | | | | | |
| | | | | 04/01/2024 (d)(e) HUF | 11 991 000 | 34 634 | 0,47 | | 8 884 015 | 88 526 | 1,19 | |
| | | | | Total des Instruments à court terme | | | | | | | 470 418 | 6,32 |
| | | | | | | 34 637 | 0,47 | | | | | |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | TOTAL DES VALEURS MOBILIÈRES | | | | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | | |
| Obligations du Trésor américain | | | | Total des Valeurs mobilières | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | |
| 4,000 % éch. 15/11/2042 | 98 500 | 95 757 | 1,29 | \$ 6 280 493 | 84,41 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | | | |
| Total États-Unis | 2 699 124 | 36,27 | ACTIONS | | | | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g) | | | | | |
| VENEZUELA | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g) | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | Total des Fonds d'investissement | | | | |
| Petroles de Venezuela S.A. | | | | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (g) | | | | \$ 739 526 | | | | |
| 6,000 % éch. 16/05/2034 | 8 400 | 966 | 0,01 | 3 514 066 | 32 470 | 0,44 | 9,94 | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (g) | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement vénézuélien | | | | 329 154 | | | | 3 045 | | | | |
| 6,000 % éch. 09/12/2020 ^ | 2 651 | 371 | 0,01 | | | 0,04 | | | | | | |
| 7,000 % éch. 31/03/2048 ^ | 16 792 | 2 569 | 0,03 | | | | | | | | | |
| 9,250 % éch. 07/05/2038 ^ | 7 813 | 1 364 | 0,02 | | | | | | | | | |
| | | 4 304 | 0,06 | | | | | | | | | |
| Total Venezuela | | 5 270 | 0,07 | | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--|------------------|--|--|---------------------|
| BSN | 4,980 % | 28/12/2023 | 03/01/2024 | CAD 110 000 | Obligation internationale du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/12/2031 | \$ (84 905) | \$ 83 422 | \$ 83 512 | 1,12 |
| CEW | 4,960 | 27/12/2023 | 03/01/2024 | 200 000 | Province de l'Ontario 3,500 % éch. 02/06/2024 | (155 333) | 151 676 | 151 866 | 2,04 |
| | 4,980 | 11/12/2023 | 03/01/2024 | 1 000 000 | Province de l'Ontario 2,800 % - 3,650 % éch. 02/06/2033 - 02/06/2048 | (674 322) | 758 380 | 761 518 | 10,20 |
| | | | | | Province du Québec 3,100 % - 3,250 % éch. 01/09/2032 - 01/12/2051 | (127 655) | | | |
| DEU | 5,480 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | \$ 81 300 | Billets du Trésor américain 1,750 % éch. 31/01/2029 | (83 024) | 81 300 | 81 312 | 1,09 |
| | 5,510 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 100 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/02/2042 | (103) | 100 | 100 | 0,00 |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 42 525 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | (43 376) | 42 525 | 42 534 | 0,57 |
| | 5,330 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 62 000 | Billets du Trésor américain 1,375 % éch. 31/12/2028 | (63 240) | 62 000 | 62 000 | 0,83 |
| IND | 5,215 | 18/12/2023 | 03/01/2024 | £ 33 000 | Bon du Trésor britannique indexé sur l'inflation 3,750 % éch. 22/10/2053 | (43 772) | 42 068 | 42 144 | 0,57 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (1 275 730) | \$ 1 221 471 | \$ 1 224 986 | 16,42 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 156 | \$ 355 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 648 | (4) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 311 | 6 291 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 4 548 | (3 124) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 3 590 | 6 821 | 0,09 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 5 643 | 12 633 | 0,17 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 4 100 | 15 578 | 0,21 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 2 350 | 27 868 | 0,38 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 207 | 1 814 | 0,02 |
| | | | | \$ 68 232 | 0,92 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 68 232 | 0,92 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 18 200 | \$ 49 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 12 800 | (110) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 4 400 | 69 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 500 | 10 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/06/2027 | 1 200 | 17 | 0,00 |
| Carnival Corp. | 1,000 | 20/12/2028 | 6 200 | 778 | 0,01 |
| Cellnex Telecom S.A. | 5,000 | 20/12/2030 | € 12 400 | 734 | 0,01 |
| Charter Communications, Inc. | 5,000 | 20/12/2027 | \$ 21 000 | 675 | 0,01 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/12/2024 | 600 | 1 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2025 | 1 300 | 27 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2026 | 800 | 36 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2027 | 6 900 | 248 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2024 | 14 300 | 358 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 35 000 | 330 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 4 300 | 35 | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20/06/2026 | 4 200 | (378) | (0,01) |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20/12/2025 | € 20 900 | (2 705) | (0,04) |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20/12/2027 | 26 000 | (3 048) | (0,04) |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20/12/2024 | 18 600 | 1 082 | 0,02 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20/12/2028 | 11 000 | 853 | 0,01 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2024 | 40 600 | 252 | 0,00 |
| T-Mobile USA, Inc. | 5,000 | 20/06/2028 | \$ 1 400 | 14 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20/12/2026 | € 5 200 | (43) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20/06/2027 | 8 300 | 341 | 0,01 |
| | | | | \$ (375) | (0,01) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/12/2028 | \$ 569 844 | \$ 29 055 | 0,40 |
| Indice CDX.IG-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2028 | 2 900 | 26 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 245 700 | 1 743 | 0,02 |
| | | | | \$ 30 824 | 0,42 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 0,500 % | 16/09/2025 | £ 21 100 | \$ 1 978 | 0,03 |
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 4 600 | 766 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 45 700 | (3 329) | (0,04) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/06/2032 | ¥ 12 250 000 | 1 092 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | \$ 1 200 | 55 | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 0,880 | 03/03/2024 | CAD 273 400 | (4 814) | (0,06) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 2,500 | 19/06/2029 | 91 700 | (6 553) | (0,09) |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | 80 700 | 1 089 | 0,01 |
| À payer ⁽³⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | AUD 103 000 | 1 515 | 0,02 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,520 | 07/07/2027 | € 127 500 | (3 611) | (0,05) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 38 500 | (350) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 83 700 | 92 | 0,00 |
| | | | | | \$ (12 070) | (0,16) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 18 379 | 0,25 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/12/2028 | \$ 23 600 | \$ (466) | \$ 143 | \$ (323) | (0,01) |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2028 | 22 000 | (1 915) | 1 155 | (760) | (0,01) |
| BPS | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2028 | 23 700 | (458) | 134 | (324) | (0,01) |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/06/2031 | 61 600 | (2 646) | 2 486 | (160) | 0,00 |
| | Intrum AB | 5,000 | 20/12/2024 | € 1 200 | 113 | (123) | (10) | 0,00 |
| DUB | Eskom Holdings SOC Ltd. | 4,650 | 30/06/2029 | \$ 5 000 | 0 | 434 | 434 | 0,01 |
| GST | ADLER Real Estate AG | 5,000 | 20/12/2026 | € 7 400 | (46) | (1 407) | (1 453) | (0,02) |
| | Intrum AB | 5,000 | 20/12/2024 | 19 600 | 1 957 | (2 124) | (167) | 0,00 |
| JPM | Intrum AB | 5,000 | 20/12/2024 | 1 000 | 92 | (101) | (9) | 0,00 |
| MYC | Intrum AB | 5,000 | 20/12/2024 | 3 300 | 350 | (378) | (28) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2028 | \$ 22 400 | (1 302) | 528 | (774) | (0,01) |
| MYI | Intrum AB | 5,000 | 20/12/2024 | € 12 600 | 604 | (711) | (107) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2028 | \$ 26 700 | (1 555) | 633 | (922) | (0,01) |
| | | | | | \$ (5 272) | \$ 669 | \$ (4 603) | (0,06) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 2 316 | \$ 1 533 | \$ 0 | \$ (47) | 0,00 | |
| BOA | 01/2024 | CAD | 4 322 | 3 191 | 0 | (87) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 15 291 | 19 390 | 0 | (103) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 234 997 | 1 592 | 0 | (76) | 0,00 | |
| | 01/2024 | PEN | 63 643 | 17 151 | 0 | (28) | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 220 | CNY 1 558 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | INR | 6 822 | \$ 82 | 0 | 0 | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | CAD | 1 049 447 | 774 869 | 0 | (21 028) | (0,28) | |
| | 01/2024 | € | 1 572 882 | 1 730 859 | 0 | (7 026) | (0,10) | |
| | 01/2024 | £ | 32 260 | 40 921 | 0 | (206) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 4 952 122 | 14 094 | 0 | (216) | 0,00 | |
| | 01/2024 | PEN | 4 992 | 1 340 | 0 | (7) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 086 | AUD 1 597 | 3 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 14 007 | CAD 18 582 | 87 | 0 | 87 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 7 542 | € 6 843 | 40 | (21) | 19 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 5 | HUF 1 882 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 1 104 | ZAR 20 474 | 14 | 0 | 14 | 0,00 | |
| | 02/2024 | 391 | CNY 2 778 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 43 | \$ 6 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | INR | 23 695 | 283 | 0 | 0 | 0,00 | |
| BRC | 01/2024 | CAD | 8 484 | 6 346 | 0 | (89) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 497 | 631 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 6 834 | CAD 9 283 | 207 | 0 | 207 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 888 | € 1 727 | 20 | 0 | 20 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 761 | PLN 3 326 | 85 | 0 | 85 | 0,00 | |
| | 04/2024 | 7 095 | TRY 229 806 | 0 | (97) | (97) | 0,00 | |
| CBK | 01/2024 | CAD | 358 | \$ 264 | 0 | (8) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 2 450 | 3 080 | 0 | (43) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 1 010 007 | 2 883 | 0 | (35) | 0,00 | |
| | 01/2024 | NOK | 1 680 | 157 | 0 | (8) | 0,00 | |
| | 01/2024 | TRY | 89 | 3 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 017 | AUD 1 513 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 133 | CAD 1 533 | 29 | 0 | 29 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 3 266 | € 3 023 | 74 | 0 | 74 | 0,00 | |
| DUB | 01/2024 | CAD | 200 190 | \$ 150 899 | 0 | (924) | (0,01) | |
| GLM | 01/2024 | £ | 11 430 | 8 411 | 0 | (258) | (0,01) | |
| | 01/2024 | £ | 38 015 | 48 546 | 89 | (4) | 0,00 | |
| | 01/2024 | MXN | 73 023 | 4 163 | 0 | (130) | 0,00 | |
| | 02/2024 | TRY | 92 | 3 | 0 | 0 | 0,00 | |
| JPM | 01/2024 | HUF | 5 364 791 | 15 274 | 0 | (229) | 0,00 | |
| | 03/2024 | INR | 7 102 | 85 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | SGD | 477 | 359 | 0 | (3) | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | AUD | 1 574 | 1 044 | 0 | (31) | 0,00 | |
| | 01/2024 | CAD | 651 | 481 | 0 | (13) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 205 761 | 585 | 0 | (10) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 47 273 | € 43 376 | 654 | 0 | 654 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | AUD | 11 | \$ 8 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | CAD | 114 090 | 86 255 | 0 | (270) | (0,01) | |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | £ 88 | \$ 112 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 418 814 | 1 190 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 89 277 | 606 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 1 200 | 71 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD 959 | 727 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 | AUD 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 009 | € 1 824 | 9 | (3) | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 695 | £ 2 894 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 02/2024 | 230 | CNY 1 627 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 04/2024 | MXN 106 | \$ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | CAD 863 | 636 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 761 | CAD 2 324 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 15 462 | \$ 185 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | ¥ 146 800 | 1 001 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 78 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | AUD 878 | 583 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 173 965 | 220 151 | 0 | (1 627) | (1 627) | (0,02) |
| | 01/2024 | SEK 2 168 | 210 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | | | | \$ 1 329 | \$ (32 765) | \$ (31 436) | (0,42) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie M Détail en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 14 485 | AUD 21 845 | \$ 424 | \$ 0 | \$ 424 | 0,01 |
| BOA | 01/2024 | 1 006 | 1 520 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD 368 | \$ 246 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 147 | AUD 219 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | AUD 22 | \$ 15 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 6 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 32 | AUD 48 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | AUD 5 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 19 | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 626 | AUD 8 486 | 166 | 0 | 166 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | 24 | 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 6 978 | 10 517 | 200 | 0 | 200 | 0,00 |
| | | | | \$ 825 | \$ (6) | \$ 819 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CAD 430 | \$ 316 | \$ 0 | \$ (10) | \$ (10) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | \$ 98 124 | CAD 133 436 | 3 082 | 0 | 3 082 | 0,04 |
| CBK | 01/2024 | CAD 157 | \$ 118 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 200 | 147 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 109 098 | CAD 148 259 | 3 351 | 0 | 3 351 | 0,04 |
| MBC | 01/2024 | 14 943 | 20 222 | 395 | 0 | 395 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 11 947 | 15 753 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 109 717 | 148 825 | 3 161 | 0 | 3 161 | 0,04 |
| | | | | \$ 9 989 | \$ (15) | \$ 9 974 | 0,13 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation, W en CHF (couverte) de capitalisation et W en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 13 | \$ 16 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 175 | CHF 151 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF 25 | \$ 29 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 283 | CHF 1 119 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | CHF 43 | \$ 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 717 | CHF 7 595 | 311 | 0 | 311 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CHF 151 | \$ 173 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 797 | CHF 8 585 | 408 | 0 | 408 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | CHF 136 | \$ 156 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 729 | CHF 8 493 | 367 | 0 | 367 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | CHF 38 | \$ 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 1 137 | \$ (15) | \$ 1 122 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, T en EUR (couverte) de capitalisation, T en EUR (couverte) de distribution, W en EUR (couverte) de capitalisation et W en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 56 744 | \$ 61 407 | \$ 2 | \$ (1 293) | \$ (1 291) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 997 328 | € 906 033 | 3 751 | 0 | 3 751 | 0,05 |
| BRC | 01/2024 | 995 833 | 905 484 | 4 640 | 0 | 4 640 | 0,06 |
| CBK | 01/2024 | € 16 591 | \$ 18 239 | 17 | (109) | (92) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 826 | 1 980 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 881 967 | € 806 608 | 9 256 | 0 | 9 256 | 0,13 |
| SCX | 01/2024 | 129 008 | 118 226 | 1 620 | 0 | 1 620 | 0,02 |
| | | | | \$ 19 286 | \$ (1 440) | \$ 17 846 | 0,24 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Administrations en GBP (couverte) de distribution, W en GBP (couverte) de capitalisation et W en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 7 | \$ 9 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 59 359 | £ 46 849 | 366 | 0 | 366 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 195 | \$ 246 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 268 768 | £ 212 698 | 2 388 | 0 | 2 388 | 0,03 |
| BRC | 01/2024 | 974 | 770 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 20 260 | \$ 25 648 | 0 | (181) | (181) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 545 | £ 433 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | £ 15 | \$ 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 2 961 | 3 770 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 976 | £ 774 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 54 | \$ 67 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 86 | £ 67 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 333 799 | 263 898 | 2 629 | 0 | 2 629 | 0,04 |
| SSB | 01/2024 | £ 76 | \$ 96 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 10 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 333 775 | £ 263 735 | 2 445 | 0 | 2 445 | 0,03 |
| | | | | \$ 7 854 | \$ (191) | \$ 7 663 | 0,10 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Administrations en JPY (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 393 | ¥ 57 969 | \$ 19 | \$ 0 | \$ 19 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 849 | 124 592 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 654 | 96 198 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 519 | 76 469 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | | | | \$ 106 | \$ 0 | \$ 106 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en MXN (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 02/2024 | \$ 71 | MXN 1 200 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | MXN 131 113 | \$ 7 732 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 7 697 | MXN 131 113 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 224 | 3 871 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | MXN 131 113 | \$ 7 736 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 239 | MXN 4 201 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 02/2024 | 7 701 | 131 113 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | MXN 61 150 | \$ 3 540 | 0 | (70) | (70) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 6 600 | 386 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 286 | MXN 159 781 | 146 | 0 | 146 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | MXN 20 955 | \$ 1 233 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 248 | MXN 142 218 | 147 | 0 | 147 | 0,00 |
| RBC | 01/2024 | 974 | 16 893 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | MXN 131 113 | \$ 7 734 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 996 | MXN 155 081 | 158 | 0 | 158 | 0,01 |
| | 02/2024 | 7 699 | 131 113 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | | | | \$ 509 | \$ (96) | \$ 413 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 4 917 | SEK 51 286 | \$ 173 | \$ 0 | \$ 173 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | 708 | 7 390 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 274 | 2 782 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 5 413 | 56 221 | 167 | 0 | 167 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 5 468 | 56 437 | 133 | 0 | 133 | 0,00 |
| | | | | \$ 501 | \$ 0 | \$ 501 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Administration en SGD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et W en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 17 707 | SGD 23 614 | \$ 199 | \$ 0 | \$ 199 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 21 213 | 28 300 | 248 | 0 | 248 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | SGD 1 240 | \$ 925 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 325 | SGD 433 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | 4 924 | 6 568 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD 85 | \$ 64 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 040 | SGD 2 729 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 02/2024 | 705 | 930 | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 19 516 | 26 034 | 225 | 0 | 225 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 299 | \$ 227 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 128 | SGD 171 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 764 | \$ (17) | \$ 747 | 0,01 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 3 152 0,04

Total des Investissements

\$ 8 331 253 111,98

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (891 455) (11,98)

Actifs nets

\$ 7 439 798 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,18 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| Alice France S.A, 11,500 % éch. 01/02/2027 | 20/12/2023 | \$ 5 184 | \$ 5 420 | 0,07 |
| Citigroup Inc, 2,572 % éch. 03/06/2031 | 26/05/2020 | 6 900 | 5 898 | 0,08 |
| Constellation Oil Services Holding S.A, 'B' | 10/06/2022 | 92 | 91 | 0,00 |
| Corestate Capital Holding S.A, | 22/08/2023 | 0 | 0 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG 3,729 % éch. 14/01/2032 | 12/08/2022 - 16/08/2022 | 2 348 | 2 432 | 0,03 |
| DrillCo Holding Lux S.A, | 08/06/2023 | 8 869 | 11 011 | 0,15 |
| General Motors Co, 6,800 % éch. 01/10/2027 | 07/05/2020 | 699 | 743 | 0,01 |
| Intelsat Emergence S.A, | 24/02/2020 - 29/10/2021 | 16 083 | 5 257 | 0,07 |
| | | \$ 40 175 | \$ 30 852 | 0,41 |

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 51 497 \$ (31 décembre 2022 : 6 805 \$) et un montant en numéraire de 35 459 \$ (31 décembre 2022 : 4 245 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 2 346 \$ (31 décembre 2022 : 277 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 146 278 \$ (31 décembre 2022 : 268 487 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 29 812 \$ (31 décembre 2022 : 9 202 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 6 229 045 | \$ 51 448 | \$ 6 280 493 |
| Fonds d'investissement | 470 418 | 269 108 | 0 | 739 526 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 221 471 | 0 | 1 221 471 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 5 332 | 83 997 | 434 | 89 763 |
| Totaux | \$ 475 750 | \$ 7 803 621 | \$ 51 882 | \$ 8 331 253 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 6 595 189 | \$ 25 428 | \$ 6 620 617 |
| Fonds d'investissement | 609 289 | 267 341 | 0 | 876 630 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 746 323 | 0 | 1 746 323 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 69 | (18 207) | 0 | (18 138) |
| Totaux | \$ 609 358 | \$ 8 590 646 | \$ 25 428 | \$ 9 225 432 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 2,000 % | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (1 134) | \$ (1 261) | (0,02) |
| BRC | 0,500 | 20/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (14 151) | (15 723) | (0,21) |
| | 3,250 | 20/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (3 218) | (3 576) | (0,05) |
| | 3,250 | 30/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (2 611) | (2 893) | (0,04) |
| | 3,550 | 20/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (663) | (737) | (0,01) |
| JML | (1,000) | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (436) | (481) | (0,01) |
| | 0,500 | 06/07/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (3 575) | (3 982) | (0,05) |
| | 0,500 | 30/10/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (1 291) | (1 428) | (0,02) |
| | 3,000 | 08/06/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (2 124) | (2 380) | (0,03) |
| | 3,000 | 12/06/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (1 273) | (1 426) | (0,02) |
| | 3,000 | 29/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (4 222) | (4 674) | (0,06) |
| MYI | 0,500 | 02/08/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (8 240) | (9 162) | (0,12) |
| | 0,500 | 07/08/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (1 757) | (1 953) | (0,03) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (49 676) | (0,67) |

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 576 | \$ (650) | \$ (74) | \$ 58 | \$ 0 | \$ 58 |
| BOA | (539) | 420 | (119) | 941 | (920) | 21 |
| BPS | (23 811) | 26 170 | 2 359 | 650 | (800) | (150) |
| BRC | 7 734 | (12 990) | (5 256) | (2 633) | 2 650 | 17 |
| CBK | 104 | 0 | 104 | (1 931) | 1 730 | (201) |
| DUB | (490) | 280 | (210) | S/O | S/O | S/O |
| FBF | S/O | S/O | S/O | (104) | 260 | 156 |
| GLM | 3 394 | (3 020) | 374 | 233 | (250) | (17) |
| GST | (1 620) | 1 522 | (98) | (2 878) | 2 952 | 74 |
| JPM | (185) | 0 | (185) | 2 534 | (3 820) | (1 286) |
| MBC | 10 556 | (15 430) | (4 874) | 27 060 | (25 160) | 1 900 |
| MYC | (802) | 790 | (12) | (152) | 260 | 108 |
| MYI | (595) | 630 | 35 | (196) | 260 | 64 |
| RBC | 23 | 0 | 23 | (385) | 430 | 45 |
| SCX | 4 558 | (5 960) | (1 402) | 561 | (330) | 231 |
| SSB | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (41) | 0 | (41) | (772) | 660 | (112) |
| UAG | 4 291 | (3 950) | 341 | 302 | 0 | 302 |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 53,89 | 48,23 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 30,36 | 25,74 |
| Autres valeurs mobilières | 0,16 | 1,67 |
| Fonds d'investissement | 9,94 | 10,02 |
| Contrats de mise en pension | 16,42 | 19,95 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,92 | (0,32) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,25 | (0,15) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,04 | 0,27 |
| Contrats de prise en pension | (0,67) | (0,08) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Albanie | 0,24 | 0,18 |
| Angola | 0,20 | S/O |
| Argentine | 0,69 | 0,52 |
| Australie | 0,12 | 0,07 |
| Biélorussie | S/O | 0,03 |
| Bermudes | 1,14 | 0,72 |
| Brésil | 0,07 | 0,00 |
| Canada | 0,67 | 0,29 |
| Îles Caïmans | 2,20 | 2,14 |
| Chili | 0,09 | 0,08 |
| Chine | 0,01 | 0,03 |
| Colombie | 0,78 | 0,42 |
| Costa Rica | 0,07 | S/O |
| Chypre | 0,11 | 0,17 |
| Danemark | 0,19 | 0,14 |
| République dominicaine | 0,52 | 0,38 |
| Équateur | 0,39 | 0,25 |
| Égypte | 0,56 | 0,56 |
| Finlande | 0,06 | 0,08 |
| France | 2,38 | 3,16 |
| Allemagne | 2,31 | 3,24 |
| Ghana | 0,17 | 0,06 |
| Guatemala | 0,21 | S/O |
| Guernesey, Îles Anglo-normandes | 0,23 | 0,54 |
| Hong Kong | 0,08 | 0,98 |
| Hongrie | 0,42 | S/O |
| Inde | S/O | 0,02 |
| Indonésie | 1,04 | 0,60 |
| Internationales | 0,12 | S/O |
| Irlande | 6,81 | 6,34 |
| Israël | 0,09 | 0,11 |
| Italie | 3,37 | 3,95 |
| Côte d'Ivoire | 0,17 | 0,12 |
| Japon | 0,30 | 0,92 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 1,16 | 1,02 |
| Jordanie | 0,05 | S/O |
| Kazakhstan | 0,14 | S/O |
| Luxembourg | 2,73 | 3,92 |
| Macédoine du Nord | 0,10 | 0,08 |
| Île Maurice | S/O | 0,08 |
| Mexique | 2,20 | 1,79 |
| Multinationales | 0,18 | 0,33 |
| Pays-Bas | 2,79 | 3,82 |
| Nigeria | 0,48 | 0,41 |
| Oman | 0,30 | 0,31 |
| Panama | 0,38 | 0,25 |
| Pérou | 0,51 | S/O |
| Philippines | 0,03 | S/O |
| Portugal | 0,18 | 0,14 |
| Qatar | S/O | 0,12 |
| Roumanie | 0,69 | 0,07 |
| Russie | 0,10 | 0,29 |
| Arabie saoudite | 0,86 | S/O |
| Sénégal | 0,04 | S/O |
| Serbie | 0,23 | 0,07 |
| Singapour | 0,18 | 0,15 |
| Slovénie | 0,21 | 0,16 |
| Afrique du Sud | 0,36 | 0,09 |
| Espagne | 0,64 | 0,97 |
| Sri Lanka | 0,15 | 0,08 |
| Suède | 0,46 | 0,37 |
| Suisse | 0,36 | 1,22 |
| Turquie | 0,94 | 0,70 |
| Ukraine | 0,31 | 0,22 |
| Émirats arabes unis | 0,15 | 0,13 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Royaume-Uni | 4,88 | 7,14 |
| États-Unis | 36,27 | 22,65 |
| Venezuela | 0,07 | 0,03 |
| Îles Vierges britanniques | S/O | 0,06 |
| Instruments à court terme | 0,47 | 2,87 |
| Fonds d'investissement | 9,94 | 10,02 |
| Contrats de mise en pension | 16,42 | 19,95 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,92 | (0,32) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01) | (0,12) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,42 | 0,18 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,16) | (0,21) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,06) | (0,02) |
| Contrats de change à terme | (0,42) | (0,76) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,52 | 1,05 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (11,98) | (5,41) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | ÉGYPTÉ | | | |
| ANGOLA | | | | Gaci First Investment Co. | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement angolais | | | | 4,750 % éch. 14/02/2030 | | | | Obligation internationale du gouvernement égyptien | | | |
| 8,000 % éch. 26/11/2029 | \$ 500 | \$ 446 | 0,11 | 5,125 % éch. 14/02/2053 | \$ 2 000 | \$ 2 003 | 0,49 | 6,375 % éch. 11/04/2031 | € 1 300 | \$ 927 | 0,22 |
| 9,125 % éch. 26/11/2049 | 600 | 491 | 0,12 | Kaisa Group Holdings Ltd. | 800 | 726 | 0,18 | 7,500 % éch. 16/02/2061 | \$ 3 000 | 1 762 | 0,43 |
| Total Angola | | 937 | 0,23 | 9,375 % éch. 30/06/2024 ^ | 1 100 | 40 | 0,01 | Total Égypte | | 2 689 | 0,65 |
| ARGENTINE | | | | 9,750 % éch. 28/09/2023 ^ | | | | FINLANDE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 10,500 % éch. 15/01/2025 ^ | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement argentin | | | | 10,875 % éch. 23/07/2023 ^ | | | | Balder Finland Oyj | | | |
| 3,500 % éch. 09/07/2041 | 7 422 | 2 535 | 0,62 | 11,250 % éch. 16/04/2025 ^ | 2 200 | 80 | 0,02 | 1,375 % éch. 24/05/2030 | € 200 | 161 | 0,04 |
| 3,625 % éch. 09/07/2035 | 1 252 | 427 | 0,10 | 11,650 % éch. 01/06/2026 ^ | 400 | 13 | 0,00 | 2,000 % éch. 18/01/2031 | 100 | 81 | 0,02 |
| Provincia de Buenos Aires | | | | 11,700 % éch. 11/11/2025 ^ | 1 500 | 49 | 0,01 | Nokia Oyj | | | |
| 129,126 % éch. 12/04/2025 (a) ARS | 610 | 1 | 0,00 | Lima Metro Line Finance Ltd. | 400 | 14 | 0,00 | 6,625 % éch. 15/05/2039 | \$ 600 | 595 | 0,14 |
| Total Argentine | | 2 963 | 0,72 | 5,875 % éch. 05/07/2034 | 400 | 396 | 0,10 | Total Finlande | | 837 | 0,20 |
| AUSTRALIE | | | | Melco Resorts Finance Ltd. | | | | FRANCE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,875 % éch. 06/06/2025 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Santos Finance Ltd. | | | | 5,375 % éch. 04/12/2029 | | | | Altice France S.A. | | | |
| 6,875 % éch. 19/09/2033 | \$ 500 | 531 | 0,13 | Sands China Ltd. | 900 | 755 | 0,18 | 3,375 % éch. 15/01/2028 | € 100 | 88 | 0,02 |
| BERMUDES | | | | Seagate HDD Cayman | | | | 4,000 % éch. 15/07/2029 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,125 % éch. 15/01/2031 | | | | 4,250 % éch. 15/10/2029 | | | |
| Aircastle Ltd. | | | | 9,625 % éch. 01/12/2032 | | | | 5,500 % éch. 15/10/2029 | | | |
| 2,850 % éch. 26/01/2028 | 1 100 | 982 | 0,24 | Spirit Loyalty Cayman Ltd. | 300 | 216 | 0,05 | BNP Paribas S.A. | | | |
| 5,250 % éch. 11/08/2025 | 1 250 | 1 233 | 0,30 | 8,000 % éch. 20/09/2025 | 300 | 216 | 0,05 | 1,904 % éch. 30/09/2028 | 2 800 | 2 490 | 0,60 |
| NCL Corp. Ltd. | | | | Sunac China Holdings Ltd. | | | | Électricité de France S.A. | | | |
| 8,375 % éch. 01/02/2028 | 500 | 530 | 0,13 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | 583 | 61 | 0,02 | 9,125 % éch. 15/03/2033 (f) | 900 | 1 007 | 0,24 |
| Valaris Ltd. | | | | 6,250 % éch. 30/09/2027 | 583 | 46 | 0,01 | Loxam S.A.S. | | | |
| 8,375 % éch. 30/04/2030 | 300 | 308 | 0,07 | 6,500 % éch. 30/09/2027 | 1 166 | 92 | 0,02 | 2,875 % éch. 15/04/2026 | € 200 | 215 | 0,05 |
| Total Bermudes | | 3 053 | 0,74 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | 1 749 | 79 | 0,02 | Renault S.A. | | | |
| BRESIL | | | | 7,000 % éch. 30/09/2029 | | | | 2,375 % éch. 25/05/2026 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 7,250 % éch. 30/09/2030 | | | | TDF Infrastructure SASU | | | |
| Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. | | | | Trafford Centre Finance Ltd. | | | | 1,750 % éch. 01/12/2029 | | | |
| 0,000 % éch. 29/01/2024 (d)(f) | 2 332 | 80 | 0,02 | 6,064 % éch. 28/07/2038 | £ 300 | 308 | 0,07 | 0,878 % éch. 24/11/2027 | 400 | 377 | 0,09 |
| CANADA | | | | Total Îles Caïmans | | | | Total France | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 12 700 | | | | 9 124 | | | |
| Air Canada Pass-Through Trust | | | | CHINE | | | | ALLEMAGNE | | | |
| 5,250 % éch. 01/10/2030 | 436 | 428 | 0,11 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| B.C. Unlimited Liability Co. | | | | Yango Justice International Ltd. | | | | Deutsche Bank AG | | | |
| 4,375 % éch. 15/01/2028 | 700 | 669 | 0,16 | 7,500 % éch. 15/04/2024 ^ | | | | 5,882 % éch. 08/07/2031 | | | |
| Bausch & Lomb Escrow Corp. | | | | 7,500 % éch. 17/02/2025 ^ | | | | IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou | | | |
| 8,375 % éch. 01/10/2028 | 300 | 317 | 0,08 | 7,875 % éch. 04/09/2024 ^ | | | | 4,500 % de rémunération en nature) | | | |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. | | | | Total Chine | | | | 3,750 % éch. 15/09/2026 (b) € 1 550 | | | |
| 2,750 % éch. 29/03/2028 | € 2 000 | 2 112 | 0,51 | 44 | | | | 1 693 | | | |
| goeasy Ltd. | | | | COLOMBIE | | | | INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH | | | |
| 9,250 % éch. 01/12/2028 | \$ 400 | 427 | 0,10 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,250 % éch. 16/01/2027 | | | |
| Open Text Corp. | | | | Obligation internationale du gouvernement colombien | | | | ZF Finance GmbH | | | |
| 3,875 % éch. 15/02/2028 | 700 | 651 | 0,16 | 4,500 % éch. 15/03/2029 | | | | 2,750 % éch. 25/05/2027 | | | |
| Total Canada | | 4 604 | 1,12 | 5,000 % éch. 15/06/2045 | | | | 7 063 | | | |
| ÎLES CAÏMANS | | | | 8,000 % éch. 14/11/2035 | | | | Total Colombie | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | 3 950 | | | | 0,96 | | | |
| CIFC Funding Ltd. | | | | COSTA RICA | | | | COSTA RICA | | | |
| 6,640 % éch. 24/04/2031 | 988 | 988 | 0,24 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 6,710 % éch. 24/04/2030 | 1 993 | 1 989 | 0,48 | Obligation internationale du gouvernement costaricain | | | | SCUR-Alpha 1503 GmbH | | | |
| Vibrant CLO Ltd. | | | | 7,300 % éch. 13/11/2054 | | | | 10,883 % éch. 29/03/2030 | | | |
| 6,717 % éch. 15/09/2030 | 176 | 176 | 0,05 | 300 | | | | 496 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | | 3 153 | | | | 7 521 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | DANEMARK | | | | GHANA | | | |
| Sunac China Holdings Ltd. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 1,000 % éch. 30/09/2032 | 510 | 40 | 0,01 | TDC Net A/S | | | | Obligation internationale du gouvernement du Ghana | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,056 % éch. 31/05/2028 | | | | 7,750 % éch. 07/04/2029 ^ | | | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. | | | | RÉPUBLIQUE DOMINICAINE | | | | 8,125 % éch. 26/03/2032 ^ | | | |
| 2,125 % éch. 21/02/2026 | 500 | 464 | 0,11 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 8,750 % éch. 11/03/2061 ^ | | | |
| 2,528 % éch. 18/11/2027 | 1 627 | 1 443 | 0,35 | Obligation internationale du gouvernement dominicain | | | | 8,950 % éch. 26/03/2051 ^ | | | |
| Diamond Foreign Asset Co. | | | | 6,500 % éch. 15/02/2048 | | | | Total Ghana | | | |
| 8,500 % éch. 01/10/2030 | 500 | 512 | 0,12 | 300 | | | | 746 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉQUATEUR | | | | GUATEMALA | | | |
| 2,125 % éch. 21/02/2026 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 2,528 % éch. 18/11/2027 | 1 627 | 1 443 | 0,35 | Obligation internationale du gouvernement équateurien | | | | Obligation internationale du gouvernement du Guatemala | | | |
| Diamond Foreign Asset Co. | | | | 0,000 % éch. 31/07/2030 (d) | | | | 7,050 % éch. 04/10/2032 | | | |
| 8,500 % éch. 01/10/2030 | 500 | 512 | 0,12 | 2,500 % éch. 31/07/2040 | | | | 1 000 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,000 % éch. 31/07/2030 | | | | 1 065 | | | |
| Globalworth Real Estate Investments Ltd. | | | | Total Équateur | | | | GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | |
| 3,000 % éch. 29/03/2025 | € 394 | 399 | 0,10 | 1 632 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| HONG KONG | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % éch. 02/10/2026 | € 600 | \$ 424 | 0,10 |

| | | | |
|---|-------|-------|------|
| HONGRIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,375 % éch. 12/09/2033 | 1 400 | 1 657 | 0,40 |
| Magyar Export-Import Bank 6,000 % éch. 16/05/2029 | 500 | 587 | 0,14 |
| Total Hongrie | | 2 244 | 0,54 |

| | | | |
|---|----------|-------|------|
| INDONÉSIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Pertamina Persero PT 6,500 % éch. 07/11/2048 | \$ 1 700 | 1 904 | 0,46 |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 1,875 % éch. 05/11/2031 | € 500 | 450 | 0,11 |
| 6,150 % éch. 21/05/2048 | \$ 1 000 | 1 027 | 0,25 |
| | | 3 381 | 0,82 |

| | | | |
|---|---------|-------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 1,100 % éch. 12/03/2033 | € 1 000 | 877 | 0,21 |
| 1,400 % éch. 30/10/2031 | 700 | 657 | 0,16 |
| | | 1 534 | 0,37 |
| Total Indonésie | | 4 915 | 1,19 |

| | | | |
|---|-------|-------|------|
| IRLANDE | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Aurium CLO DAC 4,695 % éch. 16/01/2031 | 299 | 327 | 0,08 |
| Bain Capital Euro CLO DAC 4,733 % éch. 20/01/2032 | 1 967 | 2 147 | 0,52 |
| GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,893 % éch. 20/01/2032 | 200 | 219 | 0,05 |
| Harvest CLO DAC 4,815 % éch. 15/01/2032 | 2 500 | 2 726 | 0,66 |
| Laurelin DAC 4,713 % éch. 20/10/2031 | 1 045 | 1 143 | 0,28 |
| Palmerston Park CLO DAC 4,625 % éch. 18/04/2030 | 199 | 219 | 0,05 |
| Sculptor European CLO DAC 4,755 % éch. 14/01/2032 | 800 | 871 | 0,21 |
| Toro European CLO DAC 4,812 % éch. 15/02/2034 | 750 | 817 | 0,20 |
| 4,908 % éch. 12/01/2032 | 300 | 329 | 0,08 |
| | | 8 798 | 2,13 |

| | | | |
|---|-------|-----|------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC 2,700 % éch. 11/06/2023 ^ | 2 800 | 464 | 0,11 |

| | | | |
|---|----------|--------|------|
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | |
| Setanta Aircraft Leasing DAC 7,610 % éch. 05/11/2028 | \$ 2 600 | 2 611 | 0,64 |
| Total Irlande | | 11 873 | 2,88 |

| | | | |
|--|-------|-----|------|
| ISRAËL | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 400 | 452 | 0,11 |

| | | | |
|--|-------|-------|------|
| ITALIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % éch. 28/04/2025 | 900 | 971 | 0,23 |
| 8,000 % éch. 22/01/2030 | 1 800 | 2 006 | 0,49 |
| Intesa Sanpaolo SpA 5,148 % éch. 10/06/2030 | £ 100 | 116 | 0,03 |
| 5,500 % éch. 01/03/2028 (f)(h) | € 750 | 770 | 0,19 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| CÔTE D'IVOIRE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | € 3 775 | \$ 3 841 | 0,93 |
| Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029 | 2 600 | 2 543 | 0,62 |
| Telecom Italia SpA 7,875 % éch. 31/07/2028 | 500 | 615 | 0,15 |
| UniCredit SpA 7,296 % éch. 02/04/2034 | \$ 900 | 926 | 0,22 |
| Total Italie | | 11 788 | 2,86 |

| | | | |
|--|-------|-------|------|
| CÔTE D'IVOIRE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,750 % éch. 31/12/2032 | 1 928 | 1 826 | 0,44 |

| | | | |
|--|-------|-------|------|
| JAPON | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027 | 1 500 | 1 436 | 0,35 |

| | | | |
|--|---------|-------|------|
| JERSEY, ÎLES ANGO-NORMANDES | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| AA Bond Co. Ltd. 5,500 % éch. 31/07/2050 | £ 2 200 | 2 665 | 0,65 |
| Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % éch. 15/08/2024 | € 45 | 49 | 0,01 |
| Corsair International Ltd. 8,802 % éch. 28/01/2027 | 1 600 | 1 768 | 0,43 |
| 9,152 % éch. 28/01/2029 | 600 | 663 | 0,16 |
| G City Europe Ltd. 4,250 % éch. 11/09/2025 | 1 100 | 1 119 | 0,27 |
| Total Jersey, Îles Anglo-normandes | | 6 264 | 1,52 |

| | | | |
|---|--------|-----|------|
| KAZAKHSTAN | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| KazMunayGas National Co. JSC 5,375 % éch. 24/04/2030 | \$ 200 | 199 | 0,05 |
| 5,750 % éch. 19/04/2047 | 200 | 176 | 0,04 |
| 6,375 % éch. 24/10/2048 | 400 | 377 | 0,09 |
| Total Kazakhstan | | 752 | 0,18 |

| | | | |
|--|--------|-------|------|
| LUXEMBOURG | | | |
| ACTIONS ORDINAIRES | | | |
| Adler Group S.A. (c) Corestate Capital Holding S.A. (c)(i) | 12 561 | 7 | 0,00 |
| 210 984 | 0 | 0,00 | |
| DrillCo Holding Lux S.A. (c)(i) | 61 796 | 1 535 | 0,37 |
| Intelsat Emergence S.A. (c)(i) | 14 429 | 411 | 0,10 |
| Total Actions ordinaires | | 1 953 | 0,47 |

| | | | |
|--|-------|-----|------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | |
| Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) 8,000 % éch. 31/12/2026 ^ (b) | € 416 | 241 | 0,06 |

| | | | |
|---|----------|-------|------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Albion Financing SARL 5,250 % éch. 15/10/2026 | 400 | 443 | 0,11 |
| Altice Financing S.A. 5,750 % éch. 15/08/2029 | \$ 1 500 | 1 333 | 0,32 |
| Altice France Holding S.A. 6,000 % éch. 15/02/2028 | 700 | 337 | 0,08 |
| Aroundtown S.A. 5,375 % éch. 21/03/2029 | 800 | 660 | 0,16 |
| Chile Electricity Lux MPC SARL 6,010 % éch. 20/01/2033 | 1 000 | 1 026 | 0,25 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) 3,000 % éch. 31/12/2026 (b) | 148 | 108 | 0,03 |
| Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % en numéraire ou 11,000 % de rémunération en nature) 10,000 % éch. 31/12/2026 (b) | € 100 | 110 | 0,03 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | |
| Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) 8,000 % éch. 31/12/2026 ^ (b) | € 756 | \$ 438 | 0,10 |
| CPI Property Group S.A. 1,500 % éch. 27/01/2031 | 1 000 | 584 | 0,14 |
| 1,750 % éch. 14/01/2030 | 650 | 410 | 0,10 |
| Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % éch. 19/11/2025 | 400 | 417 | 0,10 |
| FORESEA Holding S.A. 7,500 % éch. 15/06/2030 | \$ 638 | 591 | 0,14 |
| Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 4,250 % éch. 06/04/2024 | £ 1 900 | 1 974 | 0,48 |
| Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % éch. 23/02/2038 | \$ 1 100 | 1 149 | 0,28 |
| Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % éch. 15/03/2030 | 1 072 | 1 024 | 0,25 |
| Logicor Financing SARL 3,250 % éch. 13/11/2028 | € 1 000 | 1 053 | 0,25 |
| Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % éch. 01/12/2040 | \$ 1 267 | 1 144 | 0,28 |
| | | 12 801 | 3,10 |

| | | | |
|--|---------|--------|------|
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | |
| Albion Financing SARL 9,252 % éch. 17/08/2026 | € 2 000 | 2 218 | 0,54 |
| Total Luxembourg | | 17 213 | 4,17 |

| | | | |
|--|-----|-----|------|
| MACÉDOINE DU NORD | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du Nord 2,750 % éch. 18/01/2025 | 300 | 325 | 0,08 |

| | | | |
|--|----------|-------|------|
| MEXIQUE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Petroleos Mexicanos 5,625 % éch. 23/01/2046 | \$ 1 416 | 859 | 0,21 |
| 6,625 % éch. 15/06/2035 | 1 000 | 768 | 0,18 |
| 6,750 % éch. 21/09/2047 | 3 700 | 2 426 | 0,59 |
| 7,690 % éch. 23/01/2050 | 1 384 | 986 | 0,24 |
| | | 5 039 | 1,22 |

| | | | |
|---|-------|-------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,771 % éch. 24/05/2061 | 1 600 | 1 089 | 0,26 |
| 4,500 % éch. 31/01/2050 | 600 | 492 | 0,12 |
| 5,400 % éch. 09/02/2028 | 2 800 | 2 873 | 0,70 |
| | | 4 454 | 1,08 |
| Total Mexique | | 9 493 | 2,30 |

| | | | |
|---|----------|-------|------|
| PAYS-BAS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ASR Nederland NV 7,000 % éch. 07/12/2043 | € 100 | 125 | 0,03 |
| Athora Netherlands NV 7,000 % éch. 19/06/2025 (f)(h) | 200 | 217 | 0,05 |
| CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025 | 100 | 104 | 0,03 |
| 1,500 % éch. 27/09/2031 | 100 | 86 | 0,02 |
| Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % éch. 18/03/2033 | 2 000 | 1 733 | 0,42 |
| ING Groep NV 6,500 % éch. 16/04/2025 (f)(h) | \$ 1 300 | 1 269 | 0,31 |
| 6,750 % éch. 16/04/2024 (f)(h) | 600 | 598 | 0,14 |
| NE Property BV 3,375 % éch. 14/07/2027 | € 1 500 | 1 569 | 0,38 |
| NN Group NV 4,500 % éch. 15/01/2026 (f) | 1 100 | 1 214 | 0,29 |
| Q-Park Holding BV 3,500 % éch. 01/02/2025 | 1 600 | 1 710 | 0,41 |
| Sandoz Finance BV 4,220 % éch. 17/04/2030 | 400 | 459 | 0,11 |
| Syngenta Finance NV 4,892 % éch. 24/04/2025 | \$ 1 076 | 1 062 | 0,26 |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | ACTIONS ORDINAIRES | | | | | 2,700 % éch. 10/08/2026 | \$ 700 | \$ 649 | 0,16 |
| 5,077 % éch. 25/01/2032 | \$ 3 | \$ 3 | 0,00 | ÉNERGIE | | | | | 3,375 % éch. 13/11/2025 | 300 | 287 | 0,07 |
| Ellington Loan Acquisition Trust | | | | Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (c)(i) | 161 700 | \$ 18 | 0,00 | | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC | 1 400 | 1 347 | 0,33 |
| 6,520 % éch. 25/05/2037 | 310 | 301 | 0,07 | | | | | | 6,500 % éch. 01/05/2028 | 1 400 | 1 347 | 0,33 |
| First Franklin Mortgage Loan Trust | | | | | | | | | 6,500 % éch. 01/10/2025 | 1 237 | 1 234 | 0,30 |
| 6,745 % éch. 25/07/2034 | 103 | 101 | 0,02 | | | | | | Freedom Mortgage Corp. | 1 100 | 1 051 | 0,25 |
| Fremont Home Loan Trust | | | | | | | | | 6,625 % éch. 15/01/2027 | | | |
| 6,010 % éch. 25/04/2036 | 279 | 256 | 0,06 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | Global Atlantic Fin Co. | 1 000 | 922 | 0,22 |
| 6,400 % éch. 25/06/2035 | 700 | 605 | 0,15 | Alaska Airlines Pass-Through Trust | 4,800 % éch. 15/02/2029 | \$ 459 | 447 | 0,11 | 4,400 % éch. 15/10/2029 | | | |
| GSAA Home Equity Trust | | | | AMC Networks, Inc. | 4,250 % éch. 15/02/2029 | 100 | 76 | 0,02 | GLP Capital LP | 300 | 303 | 0,07 |
| 5,590 % éch. 25/11/2036 | 74 | 17 | 0,00 | American Airlines Pass-Through Trust | 3,000 % éch. 15/04/2030 | 67 | 61 | 0,01 | GN Bondco LLC | 500 | 489 | 0,12 |
| GSAMP Trust | | | | 3,150 % éch. 15/08/2033 | 3,200 % éch. 15/12/2029 | 540 | 492 | 0,12 | Goldman Sachs Group, Inc. | 700 | 588 | 0,14 |
| 5,520 % éch. 25/12/2046 | 24 | 12 | 0,00 | 3,350 % éch. 15/04/2031 | 3,375 % éch. 01/11/2028 | 211 | 191 | 0,05 | 2,615 % éch. 22/04/2032 | | | |
| 5,560 % éch. 25/01/2037 | 40 | 23 | 0,01 | 3,575 % éch. 15/07/2029 | 3,650 % éch. 15/12/2029 | 345 | 317 | 0,08 | GTCR W-2 Merger Sub LLC | 500 | 529 | 0,13 |
| 5,950 % éch. 25/06/2036 | 188 | 99 | 0,02 | 3,650 % éch. 15/12/2029 | 3,700 % éch. 01/04/2028 | 267 | 249 | 0,06 | 7,500 % éch. 15/01/2031 | | | |
| 5,950 % éch. 25/08/2036 | 558 | 435 | 0,11 | 3,650 % éch. 15/08/2030 | American Tower Corp. | 67 | 60 | 0,01 | Haleon U.S. Capital LLC | 600 | 568 | 0,14 |
| 6,205 % éch. 25/09/2035 | 71 | 69 | 0,02 | 3,700 % éch. 01/04/2028 | 3,950 % éch. 15/03/2029 | 700 | 669 | 0,16 | HCA, Inc. | 1 000 | 1 016 | 0,25 |
| Home Equity Asset Trust | | | | 5,900 % éch. 15/11/2033 | 5,900 % éch. 15/11/2033 | 800 | 848 | 0,21 | 5,700 % éch. 15/05/2028 | 600 | 612 | 0,15 |
| 6,565 % éch. 25/05/2035 | 51 | 50 | 0,01 | Amgen, Inc. | 5,650 % éch. 02/03/2053 | 600 | 632 | 0,15 | JP Morgan Chase & Co. | 1 000 | 966 | 0,23 |
| Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | | AT&T, Inc. | 3,800 % éch. 01/12/2057 | 800 | 595 | 0,14 | 4,586 % éch. 26/04/2033 | | | |
| 5,850 % éch. 25/06/2036 | 17 | 17 | 0,00 | Aviation Capital Group LLC | 3,500 % éch. 01/11/2027 | 600 | 553 | 0,13 | Kinder Morgan Energy Partners LP | 400 | 422 | 0,10 |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | | 5,500 % éch. 15/12/2024 | 5,500 % éch. 15/12/2024 | 800 | 796 | 0,19 | 6,500 % éch. 01/02/2037 | 400 | 422 | 0,10 |
| 4,258 % éch. 25/07/2036 | 133 | 130 | 0,03 | Bank of America Corp. | 4,571 % éch. 27/04/2033 | 1 000 | 954 | 0,23 | 6,950 % éch. 15/01/2038 | 200 | 220 | 0,05 |
| 5,660 % éch. 25/03/2047 | 53 | 52 | 0,01 | BAT Capital Corp. | 3,557 % éch. 15/08/2027 | 27 | 26 | 0,01 | Las Vegas Sands Corp. | 500 | 491 | 0,12 |
| 5,730 % éch. 25/06/2037 | 23 | 23 | 0,01 | Boeing Co. | 3,950 % éch. 01/08/2059 | 500 | 383 | 0,09 | 3,200 % éch. 08/08/2024 | 500 | 572 | 0,14 |
| 5,770 % éch. 25/07/2036 | 633 | 269 | 0,07 | 3,950 % éch. 01/05/2040 | 5,705 % éch. 01/05/2040 | 500 | 517 | 0,13 | 3,500 % éch. 18/08/2026 | 600 | 572 | 0,14 |
| 5,770 % éch. 25/03/2037 | 400 | 368 | 0,09 | Booz Allen Hamilton, Inc. | 3,875 % éch. 01/09/2028 | 500 | 471 | 0,11 | 3,900 % éch. 08/08/2029 | 300 | 277 | 0,07 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | British Airways Pass-Through Trust | 4,250 % éch. 15/05/2034 | 100 | 93 | 0,02 | LifePoint Health, Inc. | 600 | 633 | 0,15 |
| 6,010 % éch. 25/05/2046 | 551 | 167 | 0,04 | Broadcom, Inc. | 3,137 % éch. 15/11/2035 | 508 | 417 | 0,10 | 11,000 % éch. 15/10/2030 | | | |
| 6,070 % éch. 25/02/2036 | 880 | 705 | 0,17 | 3,187 % éch. 15/11/2036 | 3,187 % éch. 15/11/2036 | 1 015 | 823 | 0,20 | Marvell Technology, Inc. | 500 | 517 | 0,13 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | | Cantor Fitzgerald LP | 7,200 % éch. 12/12/2028 | 400 | 410 | 0,10 | 5,750 % éch. 15/02/2029 | 500 | 517 | 0,13 |
| 5,670 % éch. 25/08/2036 | 3 669 | 1 135 | 0,27 | Charter Communications Operating LLC | 3,850 % éch. 01/04/2061 | 1 200 | 749 | 0,18 | Medline Borrower LP | 500 | 453 | 0,11 |
| 5,770 % éch. 25/03/2036 | 990 | 895 | 0,22 | Community Health Systems, Inc. | 8,000 % éch. 15/03/2026 | 149 | 149 | 0,04 | 3,875 % éch. 01/04/2029 | 500 | 472 | 0,11 |
| 6,220 % éch. 25/12/2034 | 11 | 11 | 0,00 | Coty, Inc. | 6,625 % éch. 15/07/2030 | 1 000 | 1 028 | 0,25 | 5,250 % éch. 01/10/2029 | 500 | 472 | 0,11 |
| 6,250 % éch. 25/02/2034 | 435 | 438 | 0,11 | Credit Acceptance Corp. | 9,250 % éch. 15/12/2028 | 400 | 427 | 0,10 | Midwest Connector Capital Co. LLC | 100 | 99 | 0,02 |
| 6,370 % éch. 25/04/2034 | 83 | 77 | 0,02 | Crown Castle, Inc. | 2,100 % éch. 01/04/2031 | 700 | 571 | 0,14 | Morgan Stanley | 700 | 700 | 0,17 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | 2,250 % éch. 15/01/2031 | 2,250 % éch. 15/01/2031 | 800 | 663 | 0,16 | 5,250 % éch. 21/04/2034 | | | |
| 5,610 % éch. 25/05/2037 | 188 | 138 | 0,03 | 5,000 % éch. 11/01/2028 | 5,000 % éch. 11/01/2028 | 700 | 698 | 0,17 | National Fuel Gas Co. | 200 | 199 | 0,05 |
| 5,790 % éch. 25/09/2036 | 232 | 99 | 0,02 | CVS Health Corp. | 3,250 % éch. 15/08/2029 | 500 | 466 | 0,11 | NCR Atleos Corp. | 600 | 638 | 0,15 |
| 6,050 % éch. 25/01/2035 | 560 | 558 | 0,14 | DAE Funding LLC | 3,375 % éch. 20/03/2028 | 600 | 554 | 0,13 | 9,500 % éch. 01/04/2029 | | | |
| 6,175 % éch. 25/01/2035 | 290 | 279 | 0,07 | DISH DBS Corp. | 5,750 % éch. 01/12/2028 | 600 | 480 | 0,12 | Netflix, Inc. | 1 400 | 1 419 | 0,34 |
| 9,270 % éch. 25/02/2047 | 113 | 92 | 0,02 | Elevance Health, Inc. | 4,750 % éch. 15/02/2033 | 600 | 600 | 0,15 | Newell Brands, Inc. | 400 | 333 | 0,08 |
| New Century Home Equity Loan Trust | | | | Energy Transfer LP | 7,500 % éch. 01/07/2038 | 2 000 | 2 318 | 0,56 | 6,500 % éch. 01/04/2046 | 400 | 333 | 0,08 |
| 8,470 % éch. 25/01/2033 | 172 | 146 | 0,04 | EnLink Midstream LLC | 5,375 % éch. 01/06/2029 | 300 | 294 | 0,07 | NextEra Energy Operating Partners LP | 400 | 419 | 0,10 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | EQT Corp. | 3,625 % éch. 15/05/2031 | 400 | 358 | 0,09 | 7,250 % éch. 15/01/2029 | | | |
| 5,630 % éch. 25/09/2037 | 161 | 158 | 0,04 | Ford Motor Credit Co. LLC | 2,330 % éch. 25/11/2025 | € 1 500 | 1 611 | 0,39 | NGPL PipeCo LLC | 1 400 | 1 561 | 0,38 |
| Option One Mortgage Loan Trust | | | | 2,386 % éch. 17/02/2026 | | | | | Noble Finance LLC | 450 | 469 | 0,11 |
| 5,690 % éch. 25/01/2037 | 245 | 139 | 0,03 | | | | | | 8,000 % éch. 15/04/2030 | 450 | 469 | 0,11 |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | | | | | | NuStar Logistics LP | 600 | 598 | 0,15 |
| 6,520 % éch. 25/09/2034 | 15 | 15 | 0,00 | | | | | | 5,625 % éch. 28/04/2027 | | | |
| 7,270 % éch. 25/12/2034 | 461 | 454 | 0,11 | | | | | | Occidental Petroleum Corp. | 700 | 745 | 0,18 |
| Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | | | | | | 7,875 % éch. 15/09/2031 | 1 700 | 1 936 | 0,47 |
| 5,340 % éch. 25/01/2037 | 1 336 | 453 | 0,11 | | | | | | OneMain Finance Corp. | 500 | 529 | 0,13 |
| Residential Asset Securities Corp. Trust | | | | | | | | | Organon & Co. | € 3 100 | 3 154 | 0,76 |
| 6,160 % éch. 25/11/2035 | 47 | 47 | 0,01 | | | | | | 2,875 % éch. 30/04/2028 | | | |
| 6,175 % éch. 25/09/2035 | 609 | 572 | 0,14 | | | | | | Pacific Gas & Electric Co. | \$ 100 | 94 | 0,02 |
| 6,355 % éch. 25/01/2034 | 22 | 22 | 0,01 | | | | | | 3,300 % éch. 15/03/2027 | 1 800 | 1 320 | 0,32 |
| Saxon Asset Securities Trust | | | | | | | | | 3,750 % éch. 01/07/2028 | 200 | 187 | 0,05 |
| 5,935 % éch. 25/03/2036 | 285 | 272 | 0,07 | | | | | | 4,450 % éch. 15/04/2042 | 100 | 81 | 0,02 |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | | | | | | | 4,500 % éch. 01/07/2040 | 850 | 720 | 0,17 |
| 5,650 % éch. 25/07/2036 | 85 | 29 | 0,01 | | | | | | 4,600 % éch. 15/06/2043 | 200 | 165 | 0,04 |
| 6,145 % éch. 25/01/2035 | 18 | 16 | 0,00 | | | | | | 4,650 % éch. 01/08/2028 | 300 | 288 | 0,07 |
| Soundview Home Loan Trust | | | | | | | | | Plains All American Pipeline LP | 1 500 | 1 359 | 0,33 |
| 5,935 % éch. 25/06/2036 | 4 824 | 4 018 | 0,97 | | | | | | 6,650 % éch. 15/01/2037 | 200 | 214 | 0,05 |
| Structured Asset Investment Loan Trust | | | | | | | | | | | | |
| 5,850 % éch. 25/03/2036 | 71 | 69 | 0,02 | | | | | | | | | |
| 6,100 % éch. 25/11/2035 | 258 | 248 | 0,06 | | | | | | | | | |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | | | | | | | | | | |
| 6,470 % éch. 25/08/2037 | 91 | 90 | 0,02 | | | | | | | | | |
| Structured Asset Securities Corp. Trust | | | | | | | | | | | | |
| 6,160 % éch. 25/09/2035 | 199 | 187 | 0,05 | | | | | | | | | |
| Truman Capital Mortgage Loan Trust | | | | | | | | | | | | |
| 5,730 % éch. 25/03/2036 | 300 | 297 | 0,07 | | | | | | | | | |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust | | | | | | | | | | | | |
| 5,620 % éch. 25/01/2037 | 165 | 139 | 0,03 | | | | | | | | | |
| | | 24 437 | 5,92 | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|--|----------------------------------|------------------------------|--|--|----------------------------------|------------------------------|------|
| PRA Group, Inc. | | | | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | |
| 8,375 % éch. 01/02/2028 | \$ 700 | \$ 674 | 0,16 | Banc of America Alternative Loan Trust | 5,870 % éch. 25/01/2037 | \$ 79 | \$ 59 | 0,01 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | |
| RLJ Lodging Trust LP | 200 | 190 | 0,05 | Banc of America Funding Trust | 5,061 % éch. 20/01/2047 | 41 | 35 | 0,01 | 5,500 % éch. 01/12/2052 \$ 919 \$ 925 0,22 | | | |
| Rockies Express Pipeline LLC | 700 | 641 | 0,16 | BCAP LLC Trust | 6,250 % éch. 26/08/2036 | 1 925 | 850 | 0,21 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 4,950 % éch. 15/07/2029 | 300 | 287 | 0,07 | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | 7,660 % éch. 25/02/2036 | 88 | 75 | 0,02 | 5,000 % éch. 01/02/2054 | 9 200 | 9 106 | 2,21 |
| San Diego Gas & Electric Co. | 600 | 613 | 0,15 | Citigroup Mortgage Loan Trust | 3,772 % éch. 25/10/2046 | 19 | 17 | 0,00 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 11 100 | 11 150 | 2,70 |
| 4,950 % éch. 15/08/2028 | 600 | 613 | 0,15 | Countrywide Alternative Loan Trust | 7,780 % éch. 25/10/2035 | 58 | 56 | 0,01 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 13 600 | 13 810 | 3,34 |
| Sirius XM Radio, Inc. | 400 | 357 | 0,09 | Countrywide Alternative Loan Trust | 5,870 % éch. 25/07/2036 | 3 | 1 | 0,00 | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 20 900 | 21 417 | 5,19 |
| 4,125 % éch. 01/07/2030 | 400 | 357 | 0,09 | Countrywide Alternative Loan Trust | 5,892 % éch. 20/05/2046 | 269 | 227 | 0,06 | <u>56 408 13,66</u> | | | |
| Sitio Royalties Operating Partnership LP | 450 | 467 | 0,11 | Countrywide Alternative Loan Trust | 5,970 % éch. 25/04/2036 | 537 | 218 | 0,05 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| 7,875 % éch. 01/11/2028 | 450 | 467 | 0,11 | Countrywide Alternative Loan Trust | 6,000 % éch. 25/05/2036 | 133 | 71 | 0,02 | Obligations du Trésor américain | | | |
| Southern California Edison Co. | 200 | 163 | 0,04 | Countrywide Alternative Loan Trust | 6,000 % éch. 25/02/2037 | 850 | 362 | 0,09 | 3,875 % éch. 15/05/2043 | 4 100 | 3 910 | 0,95 |
| 4,000 % éch. 01/04/2047 | 200 | 163 | 0,04 | Countrywide Alternative Loan Trust | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 195 | 109 | 0,03 | 4,375 % éch. 15/08/2043 | 2 900 | 2 961 | 0,72 |
| Spirit AeroSystems, Inc. | 100 | 110 | 0,03 | Countrywide Alternative Loan Trust | 6,492 % éch. 25/01/2036 | 10 | 9 | 0,00 | <u>6 871 1,67</u> | | | |
| 9,375 % éch. 30/11/2029 | 100 | 110 | 0,03 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | 4,377 % éch. 25/03/2037 | 8 | 7 | 0,00 | Total États-Unis | | | |
| 9,750 % éch. 15/11/2030 | 400 | 430 | 0,10 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | 5,972 % éch. 25/04/2046 | 17 | 5 | 0,00 | <u>174 030 42,15</u> | | | |
| Sprint Capital Corp. | 1 385 | 1 502 | 0,36 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | 6,000 % éch. 25/12/2036 | 334 | 136 | 0,03 | VENEZUELA | | | |
| 6,875 % éch. 15/11/2028 | 1 385 | 1 502 | 0,36 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | 6,000 % éch. 25/07/2037 | 66 | 24 | 0,01 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Standard Industries, Inc. | € 1 800 | 1 886 | 0,46 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | 6,010 % éch. 25/04/2046 | 1 715 | 497 | 0,12 | Petroles de Venezuela S.A. | | | |
| 2,250 % éch. 21/11/2026 | € 1 800 | 1 886 | 0,46 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | 6,500 % éch. 25/11/2036 | 103 | 35 | 0,01 | 6,000 % éch. 16/05/2034 | | | |
| T-Mobile USA, Inc. | \$ 400 | 345 | 0,08 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | 6,500 % éch. 25/04/2033 | 0 | 0 | 0,00 | 1 600 184 0,04 | | | |
| 2,550 % éch. 15/02/2031 | \$ 400 | 345 | 0,08 | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates | 3,500 % éch. 26/04/2038 | 72 | 70 | 0,02 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 4,950 % éch. 15/03/2028 | 500 | 507 | 0,12 | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates | 4,817 % éch. 27/09/2035 | 91 | 77 | 0,02 | Obligation internationale du gouvernement vénézuélien | | | |
| Tallgrass Energy Partners LP | 500 | 473 | 0,11 | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust | 5,967 % éch. 25/09/2035 | 12 | 11 | 0,00 | 6,000 % éch. 09/12/2020 ^ | | | |
| 5,500 % éch. 15/01/2028 | 500 | 473 | 0,11 | HarborView Mortgage Loan Trust | 5,910 % éch. 19/05/2035 | 147 | 134 | 0,03 | 7,000 % éch. 31/03/2048 ^ | | | |
| 6,000 % éch. 31/12/2030 | 300 | 279 | 0,07 | HarborView Mortgage Loan Trust | 5,950 % éch. 19/06/2035 | 3 | 3 | 0,00 | 7,750 % éch. 13/10/2029 ^ | | | |
| Time Warner Cable LLC | 500 | 453 | 0,11 | HarborView Mortgage Loan Trust | 6,012 % éch. 20/10/2045 | 286 | 253 | 0,06 | <u>538 0,13</u> | | | |
| 5,875 % éch. 15/11/2040 | 500 | 453 | 0,11 | HarborView Mortgage Loan Trust | 6,090 % éch. 19/11/2035 | 3 | 2 | 0,00 | Total Venezuela | | | |
| TransDigm, Inc. | 400 | 420 | 0,10 | HSI Asset Securitization Corp. Trust | 5,910 % éch. 25/11/2035 | 1 341 | 1 271 | 0,31 | <u>722 0,17</u> | | | |
| 7,125 % éch. 01/12/2031 | 400 | 420 | 0,10 | IndyMac Mortgage Loan Trust | 3,088 % éch. 25/06/2037 | 10 | 9 | 0,00 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| U.S. Acute Care Solutions LLC | 75 | 63 | 0,02 | IndyMac Mortgage Loan Trust | 4,259 % éch. 25/12/2036 | 2 | 2 | 0,00 | BONS DU TRÉSOR ARGENTIN | | | |
| 6,375 % éch. 01/03/2026 | 75 | 63 | 0,02 | IndyMac Mortgage Loan Trust | 5,830 % éch. 25/07/2047 | 53 | 36 | 0,01 | (34,368) % éch. | | | |
| U.S. Airways Pass-Through Trust | 152 | 145 | 0,04 | Lehman Mortgage Trust | 6,000 % éch. 25/09/2037 | 100 | 93 | 0,02 | 20/05/2024 (d)(e) ARS 2 951 5 0,00 | | | |
| 3,950 % éch. 15/05/2027 | 152 | 145 | 0,04 | Luminent Mortgage Trust | 5,870 % éch. 25/10/2046 | 638 | 560 | 0,14 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | |
| United Airlines Pass-Through Trust | 83 | 72 | 0,02 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | 4,347 % éch. 25/05/2036 | 3 | 3 | 0,00 | 10,900 % éch. | | | |
| 2,900 % éch. 01/11/2029 | 83 | 72 | 0,02 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | 6,130 % éch. 25/11/2029 | 1 | 1 | 0,00 | 04/01/2024 (d)(e) HUF 664 000 1 918 0,46 | | | |
| 3,450 % éch. 01/06/2029 | 127 | 118 | 0,03 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | 4,768 % éch. 25/03/2036 | 29 | 18 | 0,01 | Total des Instruments à court terme | | | |
| 3,450 % éch. 07/01/2030 | 137 | 122 | 0,03 | Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust | 5,470 % éch. 25/08/2035 | 0 | 0 | 0,00 | <u>1 923 0,46</u> | | | |
| 3,500 % éch. 01/09/2031 | 152 | 139 | 0,03 | Residential Accredited Loans, Inc. Trust | 5,870 % éch. 25/05/2047 | 58 | 51 | 0,01 | Total des Valeurs mobilières | | | |
| 4,150 % éch. 11/10/2025 | 242 | 241 | 0,06 | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | 5,910 % éch. 25/06/2037 | 174 | 141 | 0,03 | <u>\$ 363 886 88,14</u> | | | |
| 4,150 % éch. 11/10/2025 | 242 | 241 | 0,06 | Structured Asset Mortgage Investments Trust | 5,870 % éch. 25/05/2036 | 432 | 340 | 0,08 | ACTIONS | | | |
| 5,875 % éch. 15/04/2029 | 2 135 | 2 164 | 0,52 | Structured Asset Mortgage Investments Trust | 5,890 % éch. 25/09/2047 | 526 | 437 | 0,11 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC | 1 000 | 996 | 0,24 | SunTrust Alternative Loan Trust | 5,750 % éch. 25/12/2035 | 1 | 1 | 0,00 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 6,250 % éch. 15/01/2030 | 1 000 | 996 | 0,24 | Thornburg Mortgage Securities Trust | 6,720 % éch. 25/06/2037 | 10 | 9 | 0,00 | PIMCO Funds: Global | | | |
| Venture Global LNG, Inc. | 2 200 | 2 224 | 0,54 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | 6,212 % éch. 25/11/2042 | 5 | 5 | 0,00 | Investors Series plc - | | | |
| 8,125 % éch. 01/06/2028 | 2 200 | 2 224 | 0,54 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | 4,052 % éch. 25/09/2036 | 125 | 37 | 0,01 | Fonds US Short-Term Fund (g) | | | |
| Verizon Communications, Inc. | 2 200 | 1 831 | 0,44 | Total des Fonds d'investissement | | | | | | | <u>\$40 652 9,85</u> | |
| 2,355 % éch. 15/03/2032 | 2 200 | 1 831 | 0,44 | | | | | | | | | |
| VICI Properties LP | 200 | 195 | 0,05 | | | | | | | | | |
| 3,500 % éch. 15/02/2025 | 250 | 230 | 0,06 | | | | | | | | | |
| 3,875 % éch. 15/02/2029 | 250 | 239 | 0,06 | | | | | | | | | |
| 4,500 % éch. 15/01/2028 | 250 | 239 | 0,06 | | | | | | | | | |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | \$ 300 | 365 | 0,09 | | | | | | | | | |
| 3,600 % éch. 20/11/2025 | \$ 300 | 365 | 0,09 | | | | | | | | | |
| Wells Fargo & Co. | \$ 850 | 868 | 0,21 | | | | | | | | | |
| 5,574 % éch. 25/07/2029 | \$ 850 | 868 | 0,21 | | | | | | | | | |
| WMG Acquisition Corp. | 1 100 | 944 | 0,23 | | | | | | | | | |
| 3,000 % éch. 15/02/2031 | 1 100 | 944 | 0,23 | | | | | | | | | |
| XPO, Inc. | 500 | 507 | 0,12 | | | | | | | | | |
| 6,250 % éch. 01/06/2028 | 500 | 507 | 0,12 | | | | | | | | | |
| | | | <u>74 785 18,11</u> | | | | | | | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | | | | | | | |
| Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 7,708 % éch. 22/06/2028 | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |
| CenturyLink, Inc. | 1 222 | 847 | 0,21 | | | | | | | | | |
| 7,720 % éch. 15/03/2027 | 1 222 | 847 | 0,21 | | | | | | | | | |
| Charter Communications Operating LLC | 2 568 | 2 571 | 0,62 | | | | | | | | | |
| 7,133 % éch. 01/02/2027 | 2 568 | 2 571 | 0,62 | | | | | | | | | |
| CommScope, Inc. | 479 | 429 | 0,10 | | | | | | | | | |
| 8,720 % éch. 06/04/2026 | 479 | 429 | 0,10 | | | | | | | | | |
| Standard Industries, Inc. | 1 303 | 1 307 | 0,32 | | | | | | | | | |
| 7,721 % éch. 22/09/2028 | 1 303 | 1 307 | 0,32 | | | | | | | | | |
| | | | <u>5 154 1,25</u> | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|-----------|--|---------------------|
| | | | | | | | | | | |
| BPS | 5,470 % | 02/01/2024 | 03/01/2024 | \$ 32 200 | Billets du Trésor américain 1,250 % échéance 15/08/2031 | \$ (32 903) | \$ 32 200 | \$ 32 205 | 7,80 | |
| | 5,510 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 100 | Billets du Trésor américain 2,125 % échéance 15/05/2025 | (102) | 100 | 100 | 0,02 | |
| BSN | 5,340 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 34 900 | Billets du Trésor américain 2,625 % échéance 31/07/2029 | (35 656) | 34 900 | 34 921 | 8,46 | |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 2 352 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | (2 399) | 2 352 | 2 353 | 0,57 | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | \$ (71 060) | \$ 69 552 | \$ 69 579 | 16,85 |

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Long | 03/2024 | 8 | \$ 17 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 25 | 114 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 160 | 343 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 8 | (1) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 479 | 1 837 | 0,45 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 115 | (662) | (0,16) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 103 | 1 332 | 0,32 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 13 | 116 | 0,03 |
| | | | | \$ 3 096 | 0,75 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 3 096 | 0,75 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 1 900 | \$ (15) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 300 | 5 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 500 | 6 | 0,00 |
| Carnival Corp. | 1,000 | 20/12/2028 | 400 | 50 | 0,01 |
| Charter Communications, Inc. | 5,000 | 20/12/2027 | 1 000 | 33 | 0,01 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2027 | 1 000 | 42 | 0,01 |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20/12/2025 | € 2 400 | (309) | (0,08) |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20/12/2024 | 2 600 | 150 | 0,04 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2024 | 4 000 | 26 | 0,01 |
| | | | | \$ (12) | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/12/2028 | \$ 33 165 | \$ 1 783 | 0,43 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 500 | \$ (111) | (0,03) |
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 900 | (104) | (0,03) |
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 2 800 | (204) | (0,05) |
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 4 000 | (101) | (0,02) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050 | 15/12/2031 | ¥ 940 000 | 69 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2027 | \$ 67 100 | (146) | (0,04) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2030 | 22 300 | 3 695 | 0,89 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 17/06/2025 | 33 800 | 3 204 | 0,78 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 20 600 | (62) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2052 | 14 000 | 517 | 0,13 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 23 300 | 1 900 | 0,46 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 43 600 | 2 052 | 0,50 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 82 000 | 599 | 0,15 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 21/06/2026 | 27 700 | (287) | (0,07) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/06/2054 | 1 900 | (5) | 0,00 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/(moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 % | 21/06/2025 | \$ 27 900 | \$ 553 | 0,13 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 6 400 | 5 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 | 18/12/2026 | 13 700 | 145 | 0,03 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | CAD 1 200 | 16 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | AUD 7 600 | 112 | 0,03 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 3 600 | (220) | (0,05) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 2 100 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 22 900 | (926) | (0,22) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 23 000 | (408) | (0,10) |
| | | | | | \$ 10 295 | 2,49 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 12 066 | 2,92 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/12/2028 | \$ 1 400 | \$ (28) | \$ 9 | \$ (19) | (0,01) |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2028 | 2 000 | (174) | 105 | (69) | (0,02) |
| BPS | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2028 | 1 300 | (25) | 7 | (18) | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/06/2031 | 5 500 | (236) | 222 | (14) | 0,00 |
| GST | ADLER Real Estate AG | 5,000 | 20/12/2026 | € 700 | (4) | (134) | (138) | (0,03) |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2028 | \$ 2 200 | (128) | 52 | (76) | (0,02) |
| | | | | | \$ (595) | \$ 261 | \$ (334) | (0,08) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 511 | \$ 649 | \$ 0 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN 3 534 | 952 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 2 231 | 2 424 | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 1 950 | 2 473 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 133 784 | 381 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 28 700 | 195 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 814 | £ 643 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 | HUF 1 017 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | £ 144 | \$ 181 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 300 | € 4 848 | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| | 04/2024 | 450 | TRY 14 577 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | HUF 9 566 | \$ 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 101 | € 1 019 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| | 02/2024 | BRL 1 403 | \$ 274 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| GLM | 01/2024 | £ 163 | 208 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN 380 | 102 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 99 | MXN 1 736 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | HUF 498 012 | \$ 1 417 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | AUD 32 | 21 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 902 | € 1 746 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | € 21 | \$ 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 21 372 | 61 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 334 | € 302 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 027 | £ 804 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | £ 177 | \$ 223 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | € 75 288 | 82 814 | 0 | (372) | (372) | (0,09) |
| | 01/2024 | £ 10 592 | 13 404 | 0 | (99) | (99) | (0,03) |
| | | | | \$ 118 | \$ (595) | \$ (477) | (0,12) |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 788 | \$ 1 954 | \$ 0 | \$ (22) | \$ (22) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 2 105 | € 1 926 | 24 | 0 | 24 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | € 3 556 | \$ 3 851 | 1 | (79) | (78) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 86 | € 80 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | € 8 839 | \$ 9 534 | 0 | (232) | (232) | (0,06) |
| MBC | 01/2024 | 707 | 766 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 34 607 | € 31 475 | 171 | 0 | 171 | 0,04 |
| MYI | 01/2024 | 34 608 | 31 487 | 182 | 0 | 182 | 0,05 |
| UAG | 01/2024 | 33 198 | 30 181 | 149 | 0 | 149 | 0,04 |
| | | | | \$ 529 | \$ (348) | \$ 181 | 0,05 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 8 497 | £ 6 699 | \$ 43 | \$ 0 | \$ 43 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | 27 777 | 21 943 | 196 | 0 | 196 | 0,05 |
| BRC | 01/2024 | 374 | 296 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 115 | \$ 146 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 39 | £ 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | £ 111 | \$ 141 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 804 | 1 024 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 284 | £ 1 801 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 74 | \$ 93 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | \$ 81 647 | £ 64 550 | 643 | 0 | 643 | 0,16 |
| SSB | 01/2024 | £ 38 | \$ 48 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 81 452 | £ 64 550 | 839 | 0 | 839 | 0,20 |
| UAG | 01/2024 | £ 29 548 | \$ 37 404 | 0 | (265) | (265) | (0,06) |
| | 01/2024 | \$ 81 636 | £ 64 507 | 600 | 0 | 600 | 0,14 |
| | | | | \$ 2 336 | \$ (269) | \$ 2 067 | 0,50 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 1 437 0,35

Total des Investissements

\$ 490 689 118,86

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (77 850) (18,86)

Actifs nets

\$ 412 839 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (d) Titre à coupon zéro.
- (e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (g) Affilié au Fonds.
- (h) Titre convertible conditionnel.
- (i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,17 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|----------|--------------|---------------------|
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » | 10/06/2022 | \$ 18 | \$ 18 | 0,00 |
| Corestate Capital Holding S.A. | 22/08/2023 | 0 | 0 | 0,00 |
| DrillCo Holding Lux S.A. | 08/06/2023 | 1 233 | 1 535 | 0,37 |
| Intelsat Emergence S.A. | 24/02/2020 - 01/05/2020 | 1 289 | 411 | 0,10 |
| | | \$ 2 540 | \$ 1 964 | 0,47 |

(j) Un titre d'une juste valeur globale de 559 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 20 224 \$ (31 décembre 2022 : 19 045 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 290 \$ (31 décembre 2022 : 1 278 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 5 | \$ 360 156 | \$ 3 725 | \$ 363 886 |
| Fonds d'investissement | 40 097 | 555 | 0 | 40 652 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 69 552 | 0 | 69 552 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 247 | 16 352 | 0 | 16 599 |
| Totaux | \$ 40 349 | \$ 446 615 | \$ 3 725 | \$ 490 689 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 399 799 | \$ 1 785 | \$ 401 584 |
| Fonds d'investissement | 55 254 | 552 | 0 | 55 806 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 102 832 | 0 | 102 832 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 1 425 | 12 723 | 0 | 14 148 |
| Totaux | \$ 56 679 | \$ 515 906 | \$ 1 785 | \$ 574 370 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| JML | 0,500 % | 30/10/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (478) | \$ (529) | (0,13) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (529) | (0,13) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O | \$ (14) | \$ 0 | \$ (14) |
| BOA | (48) | 0 | (48) | (31) | 0 | (31) |
| BPS | 119 | 0 | 119 | 104 | 0 | 104 |
| BRC | 36 | 0 | 36 | (270) | 208 | (62) |
| CBK | (67) | 0 | (67) | 1 636 | (1 510) | 126 |
| DUB | (232) | 290 | 58 | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 2 | 0 | 2 | (204) | 270 | 66 |
| GST | (138) | 0 | (138) | (179) | 0 | (179) |
| JPM | (22) | 0 | (22) | 27 | (80) | (53) |
| MBC | 194 | (390) | (196) | (1 015) | 800 | (215) |
| MYC | (76) | 0 | (76) | S/O | S/O | S/O |
| MYI | 178 | (390) | (212) | 4 | (28) | (24) |
| RYL | (3) | 0 | (3) | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 643 | (910) | (267) | 1 547 | (1 450) | 97 |
| SSB | 838 | (730) | 108 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | S/O | S/O | S/O | 65 | (120) | (55) |
| UAG | 13 | 0 | 13 | 26 | 0 | 26 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 49,72 | 38,87 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 38,05 | 30,57 |
| Autres valeurs mobilières | 0,37 | 1,69 |
| Fonds d'investissement | 9,85 | 9,88 |
| Contrats de mise en pension | 16,85 | 18,21 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,75 | 0,25 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 2,92 | 1,95 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,35 | 0,30 |
| Contrats de prise en pension | (0,13) | S/O |

*Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Angola | 0,23 | S/O |
| Argentine | 0,72 | 0,45 |
| Australie | 0,13 | S/O |
| Biélorussie | S/O | 0,05 |
| Bermudes | 0,74 | 0,54 |
| Brésil | 0,02 | 0,00 |
| Canada | 1,12 | 0,42 |
| Îles Caïmans | 3,08 | 2,11 |
| Chili | S/O | 0,09 |
| Chine | 0,01 | 0,08 |
| Colombie | 0,96 | 0,40 |
| Costa Rica | 0,08 | S/O |
| Chypre | S/O | 0,17 |
| Danemark | 0,22 | 0,15 |
| République dominicaine | 0,60 | 0,38 |
| Équateur | 0,40 | 0,24 |
| Égypte | 0,65 | 0,59 |
| Finlande | 0,20 | 0,09 |
| France | 2,21 | 3,32 |
| Allemagne | 1,82 | 3,45 |
| Ghana | 0,18 | 0,06 |
| Guatemala | 0,26 | S/O |
| Guernesey, Îles Anglo-normandes | 0,10 | 0,43 |
| Hong Kong | 0,10 | 1,08 |
| Hongrie | 0,54 | S/O |
| Inde | S/O | 0,05 |
| Indonésie | 1,19 | 0,45 |
| Irlande | 2,88 | 2,38 |
| Israël | 0,11 | S/O |
| Italie | 2,86 | 4,15 |
| Côte d'Ivoire | 0,44 | S/O |
| Japon | 0,35 | 1,11 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 1,52 | 1,16 |
| Kazakhstan | 0,18 | S/O |
| Luxembourg | 4,17 | 5,22 |
| Macédoine du Nord | 0,08 | 0,05 |
| Île Maurice | S/O | 0,13 |
| Mexique | 2,30 | 1,67 |
| Multinationales | S/O | 0,42 |
| Pays-Bas | 2,79 | 3,96 |
| Nigeria | 0,39 | 0,44 |
| Oman | 0,25 | 0,27 |
| Panama | 0,35 | S/O |
| Pérou | 0,56 | S/O |
| Qatar | S/O | 0,22 |
| Roumanie | 0,95 | 0,14 |
| Russie | 0,02 | 0,14 |
| Arabie saoudite | 1,12 | S/O |
| Sénégal | 0,04 | S/O |
| Serbie | 0,43 | S/O |
| Slovénie | 0,41 | 0,27 |
| Afrique du Sud | 0,41 | 0,07 |
| Espagne | 0,44 | 0,62 |
| Sri Lanka | 0,14 | 0,09 |
| Suède | 0,14 | 0,35 |
| Suisse | 0,16 | 0,58 |
| Turquie | 0,88 | 0,85 |
| Ukraine | 0,33 | 0,20 |
| Émirats arabes unis | 0,21 | 0,15 |
| Royaume-Uni | 4,89 | 4,30 |
| États-Unis | 42,15 | 22,26 |
| Venezuela | 0,17 | 0,07 |
| Îles Vierges britanniques | S/O | 0,08 |
| Instruments à court terme | 0,46 | 5,18 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Fonds d'investissement | 9,85 | 9,88 |
| Contrats de mise en pension | 16,85 | 18,21 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,75 | 0,25 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,12) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,43 | 0,23 |
| Swaps de taux d'intérêt | 2,49 | 1,84 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,08) | (0,01) |
| Contrats de change à terme | (0,12) | (0,46) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,55 | 0,77 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (18,86) | (1,72) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income ESG Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | ÉGYPTE | | | | INDONÉSIE | | | |
| ARGENTINE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Obligation internationale du gouvernement égyptien | | | | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia | | | |
| Obligation internationale du gouvernement argentin | | | | 6,375 % éch. 11/04/2031 | | | | 4,700 % éch. 06/06/2032 | | | |
| 3,500 % éch. 09/07/2041 | | | | \$ 900 \$ 308 0,53 | | | | \$ 500 \$ 505 0,88 | | | |
| BERMUDES | | | | SALVADOR | | | | IRLANDE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| NCL Corp. Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement salvadorien | | | | AIB Group PLC | | | |
| 8,375 % éch. 01/02/2028 | | | | 7,650 % éch. 15/06/2035 | | | | 5,250 % éch. 23/10/2031 | | | |
| 200 212 0,37 | | | | \$ 150 118 0,20 | | | | € 100 120 0,21 | | | |
| BRÉSIL | | | | FRANCE | | | | Bank of Ireland Group PLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,253 % éch. 16/09/2026 | | | |
| Banco BTG Pactual S.A. | | | | Altice France S.A. | | | | GE Capital UK Funding Unlimited Co. | | | |
| 2,750 % éch. 11/01/2026 | | | | 5,125 % éch. 15/07/2029 | | | | 5,875 % éch. 18/01/2033 | | | |
| 100 94 0,16 | | | | 11,500 % éch. 01/02/2027 (a)(g) | | | | £ 50 69 0,12 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | AXA S.A. | | | | Perrigo Finance Unlimited Co. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | 5,500 % éch. 11/07/2043 | | | | 4,650 % éch. 15/06/2030 | | | |
| 5,000 % éch. 27/01/2045 | | | | 100 119 0,21 | | | | \$ 200 182 0,32 | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 | | | | BNP Paribas S.A. | | | | Total Irlande | | | |
| 200 164 0,29 | | | | 8,500 % éch. 14/08/2028 (d)(f) | | | | 573 1,00 | | | |
| 200 208 0,36 | | | | Cerba Healthcare SACA | | | | ITALIE | | | |
| 372 0,65 | | | | 3,500 % éch. 31/05/2028 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Total Brésil | | | | Crown European Holdings S.A. | | | | Intesa Sanpaolo SpA | | | |
| 466 0,81 | | | | 2,875 % éch. 01/02/2026 | | | | 8,248 % éch. 21/11/2033 | | | |
| CANADA | | | | Électricité de France S.A. | | | | 50 54 0,10 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Forvia SE | | | | Mundys SpA | | | |
| Air Canada Pass-Through Trust | | | | 2,375 % éch. 15/06/2029 | | | | 1,875 % éch. 12/02/2028 | | | |
| 5,250 % éch. 01/10/2030 | | | | € 200 202 0,35 | | | | € 200 203 0,35 | | | |
| 374 367 0,64 | | | | JCDecaux SE | | | | Nexi SpA | | | |
| ÎLES CAÏMANS | | | | 5,000 % éch. 11/01/2029 | | | | 2,125 % éch. 30/04/2029 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Loxam S.A.S. | | | | Telecom Italia SpA | | | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. | | | | 4,500 % éch. 15/02/2027 | | | | 1,625 % éch. 18/01/2029 | | | |
| 2,528 % éch. 18/11/2027 | | | | 100 111 0,19 | | | | 7,875 % éch. 31/07/2028 | | | |
| 100 89 0,16 | | | | Société Générale S.A. | | | | Total Italie | | | |
| Seagate HDD Cayman | | | | 6,691 % éch. 10/01/2034 | | | | 574 1,00 | | | |
| 3,125 % éch. 15/07/2029 | | | | Vilmorin & Cie S.A. | | | | CÔTE D'IVOIRE | | | |
| 50 41 0,07 | | | | 1,375 % éch. 26/03/2028 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 200 192 0,33 | | | | Total France | | | | Obligation internationale du gouvernement de Côte | | | |
| 5,750 % éch. 01/12/2034 | | | | 1 897 3,30 | | | | d'Ivoire | | | |
| 200 322 0,56 | | | | ALLEMAGNE | | | | 6,125 % éch. 15/06/2033 | | | |
| Total Îles Caïmans | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | \$ 100 92 0,16 | | | |
| 322 0,56 | | | | Deutsche Bank AG | | | | JAPON | | | |
| CHILI | | | | 1,625 % éch. 20/01/2027 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 1,875 % éch. 23/02/2028 | | | | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement chilien | | | | 3,742 % éch. 07/01/2033 | | | | 5,475 % éch. 22/02/2031 | | | |
| 3,100 % éch. 07/05/2041 | | | | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | | | | 200 205 0,36 | | | |
| 300 229 0,40 | | | | 1,875 % éch. 31/03/2028 | | | | 3,490 % éch. 05/09/2027 | | | |
| COLOMBIE | | | | Schaeffler AG | | | | € 300 333 0,58 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 3,375 % éch. 12/10/2028 | | | | Norinchukin Bank | | | |
| Obligation internationale du gouvernement colombien | | | | ZF Finance GmbH | | | | 5,430 % éch. 09/03/2028 | | | |
| 5,000 % éch. 15/06/2045 | | | | 2,000 % éch. 06/05/2027 | | | | \$ 200 204 0,35 | | | |
| 300 234 0,41 | | | | Total Allemagne | | | | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | |
| 7,500 % éch. 02/02/2034 | | | | 634 1,10 | | | | 2,472 % éch. 14/01/2029 | | | |
| 300 317 0,55 | | | | GHANA | | | | 100 89 0,15 | | | |
| 551 0,96 | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | |
| COSTA RICA | | | | Obligation internationale du gouvernement du Ghana | | | | 5,500 % éch. 09/03/2028 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 7,875 % éch. 11/02/2035 ^ | | | | 200 205 0,36 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain | | | | \$ 350 154 0,27 | | | | Total Japon | | | |
| 5,625 % éch. 30/04/2043 | | | | Total Allemagne | | | | 1 036 1,80 | | | |
| 150 138 0,24 | | | | HONG KONG | | | | KAZAKHSTAN | | | |
| DANEMARK | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Lenovo Group Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement kazakh | | | |
| TDC Net A/S | | | | 6,536 % éch. 27/07/2032 | | | | 6,500 % éch. 21/07/2045 | | | |
| 5,618 % éch. 06/02/2030 | | | | 200 213 0,37 | | | | 200 229 0,40 | | | |
| € 300 343 0,59 | | | | HONGRIE | | | | LIBÉRIA | | | |
| RÉPUBLIQUE DOMINICAINE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Obligation internationale du gouvernement hongrois | | | | Royal Caribbean Cruises Ltd. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | | | | 2,125 % éch. 22/09/2031 | | | | 4,250 % éch. 01/07/2026 | | | |
| 4,500 % éch. 30/01/2030 | | | | 200 162 0,28 | | | | 350 338 0,59 | | | |
| \$ 100 92 0,16 | | | | 6,750 % éch. 25/09/2052 | | | | LUXEMBOURG | | | |
| 6,500 % éch. 15/02/2048 | | | | 200 224 0,39 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 200 192 0,33 | | | | Total Hongrie | | | | Altice Financing S.A. | | | |
| 284 0,49 | | | | 386 0,67 | | | | 5,750 % éch. 15/08/2029 | | | |
| ÉQUATEUR | | | | INDE | | | | Logicor Financing SARL | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 1,625 % éch. 17/01/2030 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement d'Équateur | | | | ReNew Power Pvt Ltd. | | | | € 200 189 0,33 | | | |
| 3,500 % éch. 31/07/2035 | | | | 5,875 % éch. 05/03/2027 | | | | Total Luxembourg | | | |
| 6,000 % éch. 31/07/2030 | | | | 275 263 0,46 | | | | 367 0,64 | | | |
| 228 107 0,18 | | | | MEXIQUE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Total Équateur | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | |
| 251 0,43 | | | | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | | 4,875 % éch. 19/05/2033 | | | |
| INDONÉSIE | | | | 4,875 % éch. 19/05/2033 | | | | \$ 200 193 0,34 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,750 % éch. 12/10/2110 | | | | 175 157 0,27 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien | | | | Total Mexique | | | | 350 0,61 | | | |
| 4,700 % éch. 06/06/2032 | | | | 350 338 0,59 | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| MAROC | | | | PHILIPPINES | | | | ROYAUME-UNI | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement marocain | | | | Obligation internationale du gouvernement philippin | | | | Atlantica Sustainable Infrastructure PLC | | | |
| 3,000 % éch. 15/12/2032 | \$ 200 | \$ 165 | 0,29 | 5,500 % éch. 17/01/2048 | \$ 250 | \$ 264 | 0,46 | 4,125 % éch. 15/06/2028 | \$ 250 | \$ 235 | 0,41 |
| MULTINATIONALES | | | | POLOGNE | | | | Barclays PLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 7,437 % éch. 02/11/2033 | | | |
| Allied Universal Holdco LLC | | | | Obligation internationale du gouvernement polonais | | | | 200 | 224 | 0,39 | |
| 3,625 % éch. 01/06/2028 | € 100 | 97 | 0,17 | 4,875 % éch. 04/10/2033 | 125 | 127 | 0,22 | Berkeley Group PLC | | | |
| American Airlines, Inc. | | | | ROUMANIE | | | | 2,500 % éch. 11/08/2031 | | | |
| 5,758 % éch. 20/04/2029 | \$ 300 | 293 | 0,51 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | HSBC Holdings PLC | | | |
| Ardagh Packaging Finance PLC | | | | Obligation internationale du gouvernement roumain | | | | 3,973 % éch. 22/05/2030 | \$ 100 | 93 | 0,16 |
| 2,125 % éch. 15/08/2026 | € 200 | 198 | 0,34 | 1,750 % éch. 13/07/2030 | € 100 | 89 | 0,16 | Land Securities Capital Markets PLC | | | |
| NXP BV | | | | 6,625 % éch. 27/09/2029 | 75 | 89 | 0,15 | 4,875 % éch. 15/09/2034 | € 100 | 131 | 0,23 |
| 5,350 % éch. 01/03/2026 | \$ 50 | 50 | 0,09 | 7,625 % éch. 17/01/2053 | \$ 200 | 225 | 0,39 | Lloyds Banking Group PLC | | | |
| Total Multinationales | | 638 | 1,11 | Total Roumanie | | 403 | 0,70 | 7,500 % éch. 27/06/2024 (d)(f) | \$ 50 | 50 | 0,09 |
| PAYS-BAS | | | | SÉNÉGAL | | | | Marks & Spencer PLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 4,500 % éch. 10/07/2027 | | | |
| AerCap Holdings NV | | | | Obligation internationale du gouvernement sénégalais | | | | £ 100 | 123 | 0,21 | |
| 5,875 % éch. 10/10/2029 | 200 | 198 | 0,34 | 4,750 % éch. 13/03/2028 | € 100 | 102 | 0,18 | National Grid PLC | | | |
| Citycon Treasury BV | | | | SERBIE | | | | 3,875 % éch. 16/01/2029 | | | |
| 1,625 % éch. 12/03/2028 | € 100 | 89 | 0,15 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | € 300 | | | |
| Cooperatieve Rabobank UA | | | | Obligation internationale du gouvernement serbe | | | | NatWest Group PLC | | | |
| 3,758 % éch. 06/04/2033 | \$ 300 | 269 | 0,47 | 1,650 % éch. 03/03/2033 | 200 | 164 | 0,28 | 0,780 % éch. 26/02/2030 | 400 | 381 | 0,66 |
| CTP NV | | | | SINGAPOUR | | | | Standard Chartered PLC | | | |
| 1,250 % éch. 21/06/2029 | € 100 | 92 | 0,16 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 0,800 % éch. 17/11/2029 | | | |
| Digital Dutch Finco BV | | | | Flex Ltd. | | | | 6,301 % éch. 09/01/2029 | \$ 50 | 51 | 0,09 |
| 1,000 % éch. 15/01/2032 | 200 | 176 | 0,31 | 4,875 % éch. 15/06/2029 | \$ 50 | 49 | 0,09 | Virgin Media Secured Finance PLC | | | |
| Enel Finance International NV | | | | AFRIQUE DU SUD | | | | 4,125 % éch. 15/08/2030 | | | |
| 2,250 % éch. 12/07/2031 | \$ 350 | 285 | 0,50 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | € 100 | | | |
| ING Groep NV | | | | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | | 4,250 % éch. 15/01/2030 | 100 | 112 | 0,20 |
| 4,125 % éch. 24/08/2033 | € 100 | 111 | 0,19 | 4,850 % éch. 30/09/2029 | 60 | 56 | 0,10 | Vmed O2 UK Financing PLC | | | |
| JDE Peet's NV | | | | 5,650 % éch. 27/09/2047 | 60 | 48 | 0,08 | 4,500 % éch. 15/07/2031 | 200 | 221 | 0,38 |
| 2,250 % éch. 24/09/2031 | \$ 50 | 40 | 0,07 | 5,750 % éch. 30/09/2049 | 300 | 241 | 0,42 | Vodafone Group PLC | | | |
| NE Property BV | | | | Total Afrique du Sud | | 345 | 0,60 | 5,125 % éch. 04/06/2081 | \$ 300 | 227 | 0,39 |
| 3,375 % éch. 14/07/2027 | € 100 | 104 | 0,18 | ESPAGNE | | | | Weir Group PLC | | | |
| Prosus NV | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,200 % éch. 13/05/2026 | | | |
| 3,061 % éch. 13/07/2031 | \$ 200 | 162 | 0,28 | Abertis Infraestructuras S.A. | | | | 200 | 186 | 0,32 | |
| Sensata Technologies BV | | | | 3,375 % éch. 27/11/2026 | £ 100 | 122 | 0,21 | Total Royaume-Uni | | 2 777 | 4,82 |
| 4,000 % éch. 15/04/2029 | 300 | 279 | 0,49 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | | ÉTATS-UNIS | | | |
| Universal Music Group NV | | | | 6,138 % éch. 14/09/2028 | \$ 200 | 206 | 0,36 | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| 4,000 % éch. 13/06/2031 | € 100 | 116 | 0,20 | Banco de Sabadell S.A. | | | | GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust | | | |
| Wabtec Transportation Netherlands BV | | | | 0,875 % éch. 16/06/2028 | € 100 | 100 | 0,17 | 5,520 % éch. 22/02/2055 | 94 | 92 | 0,16 |
| 1,250 % éch. 03/12/2027 | 50 | 51 | 0,09 | CaixaBank S.A. | | | | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | |
| Total Pays-Bas | | 1 972 | 3,43 | 3,750 % éch. 07/09/2029 | 100 | 113 | 0,20 | 5,770 % éch. 25/08/2036 | 26 | 26 | 0,05 |
| OMAN | | | | SRI LANKA | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | AES Corp. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement omanais | | | | Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka | | | | 2,450 % éch. 15/01/2031 | 250 | 210 | 0,36 |
| 6,750 % éch. 17/01/2048 | \$ 200 | 210 | 0,36 | 6,750 % éch. 18/04/2028 ^ | \$ 200 | 101 | 0,18 | 5,450 % éch. 01/06/2028 | 150 | 153 | 0,27 |
| PANAMA | | | | SUÈDE | | | | Albertsons Cos., Inc. | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,500 % éch. 15/03/2029 | | | |
| Carnival Corp. | | | | EQT AB | | | | Ally Financial, Inc. | | | |
| 4,000 % éch. 01/08/2028 | 100 | 93 | 0,16 | 0,875 % éch. 14/05/2031 | € 300 | 265 | 0,46 | 8,000 % éch. 01/11/2031 | 140 | 153 | 0,27 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | SUISSE | | | | American Tower Corp. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,900 % éch. 15/01/2030 | | | |
| 6,700 % éch. 26/01/2036 | 700 | 696 | 1,21 | UBS Group AG | | | | 2,950 % éch. 15/01/2051 | 200 | 133 | 0,23 |
| Total Panama | | 789 | 1,37 | 3,091 % éch. 14/05/2032 | \$ 250 | 213 | 0,37 | Amgen, Inc. | | | |
| PARAGUAY | | | | TOTAL | | | | 3,000 % éch. 22/02/2029 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | VALEUR NOMINALE | | | | AT&T, Inc. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen | | | | | | | | 4,300 % éch. 15/02/2030 | 300 | 294 | 0,51 |
| 5,400 % éch. 30/03/2050 | 100 | 89 | 0,15 | | | | | Avantor Funding, Inc. | | | |
| PÉROU | | | | VALEUR JUSTE | | | | 3,875 % éch. 01/11/2029 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | L'ACTIF NET | | | | 200 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | | | | | | Aviation Capital Group LLC | | | |
| 3,000 % éch. 15/01/2034 | 200 | 170 | 0,29 | | | | | 5,500 % éch. 15/12/2024 | 50 | 50 | 0,09 |
| 3,300 % éch. 11/03/2041 | 300 | 234 | 0,41 | | | | | Axalta Coating Systems LLC | | | |
| Total Pérou | | 404 | 0,70 | | | | | 3,375 % éch. 15/02/2029 | 200 | 180 | 0,31 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------|---------|----------------------------------|------------------------------|
| | | | | | | |
| INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | | | |
| BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | | | |
| 10,900 % éch. 04/01/2024 (b)(c) HUF | 81 000 | \$ 234 | 0,40 | | | |
| Total des Instruments à court terme | | 234 | 0,40 | | | |
| Total des Valeurs mobilières | | \$ 51 106 | 88,80 | | | |
| FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | | | |
| ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | | | |
| | | | | | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (e) | | | | 352 401 | 3 898 | 6,77 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (e) | | | | 147 887 | 1 572 | 2,73 |
| | | | | | 5 470 | 9,50 |
| Total des Fonds d'investissement | | \$ 5 470 | 9,50 | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---|---------------------|---|--|------------------------|
| BOS | 5,420 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 3 000 | Billets du Trésor américain 4,000 % échéance 28/02/2030 | \$ (3 067) | \$ 3 000 | \$ 3 002 | 5,21 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (3 067) | \$ 3 000 | \$ 3 002 | 5,21 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|----------------------|---------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 4 | \$ 17 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 7 | (15) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 6 | 27 | 0,05 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 2 | (2) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 7 | 14 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 19 | (44) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 24 | (99) | (0,17) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 25 | (128) | (0,22) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 11 | 120 | 0,21 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 1 | (9) | (0,02) |
| | | | | \$ (119) | (0,21) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (119) | (0,21) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Cellnex Telecom S.A. | 5,000 % | 20/12/2030 | € 100 | \$ 6 | 0,01 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|--------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|---|------------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 30 | \$ 5 | 0,01 |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 100 | 10 | 0,02 |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income ESG Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 % | 20/03/2029 | £ 100 | \$ (8) | (0,01) |
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 200 | (6) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/06/2032 | ¥ 10 000 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,850 | 20/09/2033 | 70 000 | (4) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 | 18/12/2026 | \$ 3 800 | 41 | 0,06 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | CAD 300 | 4 | 0,01 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | AUD 1 000 | 15 | 0,03 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 300 | 1 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 800 | 1 | 0,00 |
| | | | | | \$ 60 | 0,10 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 66 | 0,11 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/06/2028 | \$ 300 | \$ (17) | \$ 15 | \$ (2) | (0,01) |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2028 | 200 | (17) | 10 | (7) | (0,01) |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2027 | 100 | (17) | 12 | (5) | (0,01) |
| GST | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2028 | 400 | 0 | 5 | 5 | 0,01 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2028 | 200 | (36) | 24 | (12) | (0,02) |
| | | | | | \$ (87) | \$ 66 | \$ (21) | (0,04) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 34 | \$ 43 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | € 274 | 299 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 44 | 56 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ 33 | TRY 1 053 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | HUF 19 697 | \$ 56 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | AUD 14 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 6 776 | 7 450 | 0 | (37) | (37) | (0,07) |
| | 01/2024 | HUF 26 516 | 75 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 2 100 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | HUF 35 185 | 100 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 401 | € 367 | 5 | (1) | 4 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | 4 | HUF 1 312 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 683 | \$ 864 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | | | | \$ 5 | \$ (53) | \$ (48) | (0,08) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | € 131 | \$ 142 | \$ 0 | \$ (3) | \$ (3) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 1 870 | € 1 713 | 23 | 0 | 23 | 0,04 |
| CBK | 01/2024 | € 118 | \$ 129 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 32 | 35 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 15 203 | € 13 827 | 75 | 0 | 75 | 0,13 |
| MYI | 01/2024 | € 96 | \$ 104 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 15 071 | € 13 712 | \$ 79 | \$ 0 | \$ 79 | 0,14 |
| SCX | 01/2024 | € 240 | \$ 264 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 442 | € 404 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 13 283 | 12 076 | 60 | 0 | 60 | 0,10 |
| | | | | \$ 242 | \$ (8) | \$ 234 | 0,41 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 5 | £ 4 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 11 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 84 | 66 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 67 | 53 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 84 | 66 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 3 | \$ 0 | \$ 3 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 168 0,29

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | \$ 1 000 | \$ (970) | (1,69) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (970) | (1,69) |
| Total des Investissements | | \$ 58 721 | 102,01 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (1 158) | (2,01) |
| Actifs nets | | \$ 57 563 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^A Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------|-----------------|--------------|--------|--------------|---------------------|
| Altice France S.A. | 11,500 % | 01/02/2027 | 20/12/2023 | \$ 160 | \$ 167 | 0,29 |

Un montant en numéraire de 367 \$ (31 décembre 2022 : 113 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 51 082 | \$ 24 | \$ 51 106 |
| Fonds d'investissement | 5 470 | 0 | 0 | 5 470 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 3 000 | 0 | 3 000 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 19 | 96 | 0 | 115 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (970) | 0 | (970) |
| Totaux | \$ 5 489 | \$ 53 208 | \$ 24 | \$ 58 721 |

Tableau des investissements Fonds Diversified Income ESG Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-----------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 9 978 | \$ 0 | \$ 9 978 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 41 | (54) | 0 | (13) |
| Totaux | \$ 41 | \$ 9 924 | \$ 0 | \$ 9 965 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ (9) | \$ 0 | \$ (9) | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 |
| BRC | 10 | 0 | 10 | S/O | S/O | S/O |
| CBK | (2) | 0 | (2) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | S/O | S/O | S/O | 2 | 0 | 2 |
| GST | 5 | 0 | 5 | S/O | S/O | S/O |
| MBC | 36 | 0 | 36 | S/O | S/O | S/O |
| MYC | (12) | 0 | (12) | S/O | S/O | S/O |
| MYI | 80 | 0 | 80 | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 4 | 0 | 4 | (57) | 0 | (57) |
| SSB | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 55 | 0 | 55 | S/O | S/O | S/O |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 54,77 | 61,68 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 34,03 | 39,58 |
| Fonds d'investissement | 9,50 | S/O |
| Contrats de mise en pension | 5,21 | S/O |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,21) | 0,31 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,11 | 0,10 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,29 | (0,54) |
| Titres vendus à découvert | (1,69) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Argentine | 0,53 | 0,58 |
| Bermudes | 0,37 | S/O |
| Brésil | 0,81 | 3,50 |
| Canada | 0,64 | 0,72 |
| Îles Caïmans | 0,56 | 1,75 |
| Chili | 0,40 | 1,46 |
| Colombie | 0,96 | 1,39 |
| Costa Rica | 0,24 | S/O |
| Danemark | 0,59 | 1,07 |
| République dominicaine | 0,49 | 1,68 |
| Équateur | 0,43 | 0,47 |
| Égypte | 0,50 | S/O |
| Salvador | 0,20 | S/O |
| Finlande | S/O | 1,03 |
| France | 3,30 | 6,29 |
| Allemagne | 1,10 | 3,73 |
| Ghana | 0,27 | S/O |
| Guernesey, Îles Anglo-normandes | S/O | 0,95 |
| Hong Kong | 0,37 | S/O |
| Hongrie | 0,67 | S/O |
| Inde | 0,46 | 1,95 |
| Indonésie | 0,88 | S/O |
| Irlande | 1,00 | 1,24 |
| Italie | 1,00 | 0,88 |
| Côte d'Ivoire | 0,16 | 0,77 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Japon | 1,80 | 1,71 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | S/O | 0,91 |
| Kazakhstan | 0,40 | S/O |
| Libéria | 0,59 | S/O |
| Luxembourg | 0,64 | 1,95 |
| Mexique | 0,61 | 0,86 |
| Maroc | 0,29 | 1,40 |
| Multi-pays | S/O | 1,01 |
| Multinationales | 1,11 | 0,49 |
| Pays-Bas | 3,43 | 2,45 |
| Oman | 0,36 | 1,91 |
| Panama | 1,37 | 1,06 |
| Paraguay | 0,15 | S/O |
| Pérou | 0,70 | 0,74 |
| Philippines | 0,46 | S/O |
| Pologne | 0,22 | S/O |
| Roumanie | 0,70 | 0,76 |
| Sénégal | 0,18 | S/O |
| Serbie | 0,28 | S/O |
| Singapour | 0,09 | 0,96 |
| Afrique du Sud | 0,60 | S/O |
| Espagne | 1,98 | 3,85 |
| Sri Lanka | 0,18 | S/O |
| Suède | 0,46 | 0,75 |
| Suisse | 0,37 | S/O |
| Royaume-Uni | 4,82 | 7,18 |
| États-Unis | 50,16 | 27,59 |
| Uruguay | 0,52 | S/O |
| Instruments à court terme | 0,40 | 16,22 |
| Fonds d'investissement | 9,50 | S/O |
| Contrats de mise en pension | 5,21 | S/O |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,21) | 0,31 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines | | |
| - vente de protection | 0,01 | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,10 | 0,10 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines | | |
| - vente de protection | (0,04) | S/O |
| Contrats de change à terme | (0,08) | (0,61) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,41 | 0,07 |
| Titres vendus à découvert | (1,69) | S/O |
| Autres actifs et passifs à court terme | (2,01) | (1,13) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|---|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------|--------|----------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | VALEURS MOBILIÈRES | | | | VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | | | |
| American Airlines, Inc. 10,427 % éch. 20/04/2028 | \$ | 810 | \$ 833 | 0,03 | Banco Santander S.A. 4,375 % éch. 14/01/2026 (h)(j) | € | 3 200 | \$ 3 263 | 0,09 | Digital Dutch Finco BV 1,500 % éch. 15/03/2030 | € | 1 100 | \$ 1 059 | 0,03 |
| BCP Modular Services Holdings Ltd. 8,350 % éch. 15/12/2028 | € | 4 900 | 5 189 | 0,15 | Bank of America Corp. 2,687 % éch. 22/04/2032 | \$ | 200 | 169 | 0,00 | DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % éch. 25/01/2027 | € | 3 500 | 3 330 | 0,10 |
| Carnival Corp. 8,357 % éch. 08/08/2027 | \$ | 2 886 | 2 896 | 0,09 | Bank of Ireland Group PLC 7,500 % éch. 19/05/2025 (h)(j) | € | 3 700 | 4 149 | 0,12 | EQT AB 2,375 % éch. 06/04/2028 | € | 1 200 | 1 254 | 0,04 |
| Charter Communications Operating LLC 7,133 % éch. 01/02/2027 | | 186 | 186 | 0,01 | Barclays PLC 2,645 % éch. 24/06/2031 | \$ | 900 | 760 | 0,02 | Equinix, Inc. 0,250 % éch. 15/03/2027 | € | 1 500 | 1 509 | 0,04 |
| Delos Aircraft DAC 7,348 % éch. 31/10/2027 | | 1 840 | 1 850 | 0,05 | 3,330 % éch. 24/11/2042 | \$ | 3 600 | 2 663 | 0,08 | 3,900 % éch. 15/04/2032 | \$ | 300 | 279 | 0,01 |
| Hertz Corp. 8,720 % éch. 30/06/2028 | | 2 779 | 2 775 | 0,08 | 3,375 % éch. 02/04/2025 | € | 1 100 | 1 212 | 0,03 | Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % éch. 29/04/2030 | € | 2 500 | 2 405 | 0,07 |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,455 % éch. 08/11/2030 | | 4 774 | 4 796 | 0,14 | 4,337 % éch. 10/01/2028 | \$ | 300 | 292 | 0,01 | Fédération des Caisses Desjardins du Québec 5,860 % éch. 30/11/2026 | € | 1 700 | 2 167 | 0,06 |
| IRB Holding Corp. 8,456 % éch. 15/12/2027 | | 1 799 | 1 805 | 0,05 | 4,972 % éch. 16/05/2029 | | 300 | 295 | 0,01 | Ford Motor Credit Co. LLC 2,330 % éch. 25/11/2025 | € | 200 | 215 | 0,01 |
| LifePoint Health, Inc. 11,168 % éch. 16/11/2028 | | 4 201 | 4 196 | 0,12 | 5,304 % éch. 09/08/2026 | | 2 500 | 2 491 | 0,07 | 2,700 % éch. 10/08/2026 | \$ | 3 900 | 3 614 | 0,10 |
| MPH Acquisition Holdings LLC 9,900 % éch. 01/09/2028 | | 4 399 | 4 253 | 0,12 | 5,501 % éch. 09/08/2028 | | 600 | 603 | 0,02 | 2,748 % éch. 14/06/2024 | € | 2 300 | 2 893 | 0,08 |
| Nouryon Finance BV 8,182 % éch. 03/04/2028 | € | 5 476 | 6 064 | 0,18 | 6,375 % éch. 15/12/2025 (h)(j) | € | 1 700 | 2 067 | 0,06 | 2,900 % éch. 16/02/2028 | \$ | 1 800 | 1 617 | 0,05 |
| United Airlines, Inc. 9,220 % éch. 21/04/2028 | \$ | 1 161 | 1 167 | 0,03 | 7,125 % éch. 15/06/2025 (h)(j) | | 900 | 1 119 | 0,03 | 3,021 % éch. 06/03/2024 | € | 900 | 991 | 0,03 |
| | | | | | 7,385 % éch. 02/11/2028 | \$ | 2 500 | 2 673 | 0,08 | 3,250 % éch. 15/09/2025 | | 100 | 109 | 0,00 |
| | | | | | 7,437 % éch. 02/11/2033 | | 2 700 | 3 025 | 0,09 | 4,535 % éch. 06/03/2025 | € | 200 | 251 | 0,01 |
| | | | | | 8,000 % éch. 15/06/2024 (h)(j) | | 400 | 398 | 0,01 | G City Europe Ltd. 4,250 % éch. 11/09/2025 | € | 1 200 | 1 221 | 0,04 |
| | | | | | Bevco Lux SARL 1,000 % éch. 16/01/2030 | € | 4 400 | 4 078 | 0,12 | Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % éch. 29/07/2026 | | 1 300 | 1 185 | 0,03 |
| | | | | | BGC Group, Inc. 4,375 % éch. 15/12/2025 | \$ | 1 100 | 1 056 | 0,03 | 3,000 % éch. 29/03/2025 | | 3 100 | 3 137 | 0,09 |
| | | | | | Blue Owl Capital Corp. 2,875 % éch. 11/06/2028 | | 1 900 | 1 670 | 0,05 | Goldman Sachs Group, Inc. 1,875 % éch. 16/12/2030 | € | 2 500 | 2 659 | 0,08 |
| | | | | | Blue Owl Finance LLC 3,125 % éch. 10/06/2031 | | 4 500 | 3 713 | 0,11 | 2,615 % éch. 22/04/2032 | \$ | 200 | 168 | 0,00 |
| | | | | | BNP Paribas S.A. 1,904 % éch. 30/09/2028 | | 7 800 | 6 936 | 0,20 | 3,615 % éch. 15/03/2028 | | 2 000 | 1 919 | 0,06 |
| | | | | | 2,125 % éch. 23/01/2027 | € | 2 400 | 2 577 | 0,07 | 3,691 % éch. 05/06/2028 | | 300 | 287 | 0,01 |
| | | | | | BPCE S.A. 2,125 % éch. 13/10/2046 (j) | | 3 800 | 3 418 | 0,10 | 5,798 % éch. 10/08/2026 | | 4 200 | 4 243 | 0,12 |
| | | | | | Brown & Brown, Inc. 4,200 % éch. 15/09/2024 | \$ | 7 500 | 7 422 | 0,22 | HSBC Holdings PLC 1,750 % éch. 24/07/2027 | € | 3 200 | 3 750 | 0,11 |
| | | | | | CaixaBank S.A. 6,750 % éch. 13/06/2024 (h)(j) | € | 1 000 | 1 106 | 0,03 | 2,357 % éch. 18/08/2031 | \$ | 2 200 | 1 824 | 0,05 |
| | | | | | CapitalLand Ascendas REIT 0,750 % éch. 23/06/2028 | | 3 200 | 3 032 | 0,09 | 2,804 % éch. 24/05/2032 | | 800 | 668 | 0,02 |
| | | | | | CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % éch. 27/01/2028 | | 2 000 | 1 957 | 0,06 | 2,871 % éch. 22/11/2032 | | 5 000 | 4 157 | 0,12 |
| | | | | | 0,900 % éch. 12/10/2029 | | 2 300 | 2 116 | 0,06 | 3,973 % éch. 22/05/2030 | | 4 700 | 4 394 | 0,13 |
| | | | | | Constellation Insurance, Inc. 6,800 % éch. 24/01/2030 | \$ | 3 500 | 3 321 | 0,10 | 4,583 % éch. 19/06/2029 | | 4 170 | 4 047 | 0,12 |
| | | | | | Cooperatieve Rabobank UA 4,375 % éch. 29/06/2027 (h)(j) | € | 1 800 | 1 867 | 0,05 | 4,750 % éch. 04/07/2029 (h)(j) | € | 2 200 | 2 204 | 0,06 |
| | | | | | 5,500 % éch. 05/10/2026 | \$ | 3 000 | 3 071 | 0,09 | 5,210 % éch. 11/08/2028 | \$ | 2 600 | 2 599 | 0,08 |
| | | | | | Coventry Building Society 2,625 % éch. 07/12/2026 | € | 1 100 | 1 202 | 0,03 | 6,375 % éch. 30/03/2025 (h)(j) | | 500 | 494 | 0,01 |
| | | | | | CPI Property Group S.A. 1,500 % éch. 27/01/2031 | | 800 | 467 | 0,01 | ING Groep NV 5,750 % éch. 16/11/2026 (h)(j) | | 900 | 841 | 0,02 |
| | | | | | 1,625 % éch. 23/04/2027 | | 6 650 | 5 415 | 0,16 | Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % éch. 16/03/2028 | € | 3 100 | 3 086 | 0,09 |
| | | | | | 2,750 % éch. 12/05/2026 | | 1 100 | 1 017 | 0,03 | 3,250 % éch. 23/09/2024 | \$ | 5 800 | 5 696 | 0,17 |
| | | | | | 4,875 % éch. 16/07/2025 (h) | | 2 200 | 723 | 0,02 | 4,000 % éch. 23/09/2029 | | 400 | 364 | 0,01 |
| | | | | | Credit Suisse AG 0,250 % éch. 01/09/2028 | | 3 700 | 3 558 | 0,10 | 5,148 % éch. 10/06/2030 | € | 1 400 | 1 619 | 0,05 |
| | | | | | 0,495 % éch. 02/02/2024 | \$ | 1 800 | 1 792 | 0,05 | JAB Holdings BV 2,200 % éch. 23/11/2030 | \$ | 1 638 | 1 319 | 0,04 |
| | | | | | 7,500 % éch. 15/02/2028 | | 300 | 329 | 0,01 | JPMorgan Chase & Co. 2,595 % éch. 24/02/2026 | | 6 400 | 6 201 | 0,18 |
| | | | | | Credit Suisse AG AT1 Claim Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % éch. 19/11/2025 | € | 3 100 | 3 233 | 0,09 | 4,005 % éch. 23/04/2029 | | 4 500 | 4 333 | 0,13 |
| | | | | | Crown Castle, Inc. 3,100 % éch. 15/11/2029 | \$ | 250 | 224 | 0,01 | JPMorgan Chase Bank N.A. 5,110 % éch. 08/12/2026 | | 2 100 | 2 120 | 0,06 |
| | | | | | 3,800 % éch. 15/02/2028 | | 2 250 | 2 139 | 0,06 | Kennedy-Wilson, Inc. 4,750 % éch. 01/02/2030 | | 3 000 | 2 435 | 0,07 |
| | | | | | CTP NV 0,625 % éch. 27/09/2026 | € | 1 800 | 1 790 | 0,05 | Lazard Group LLC 4,375 % éch. 11/03/2029 | | 15 300 | 14 821 | 0,43 |
| | | | | | 1,250 % éch. 21/06/2029 | | 5 100 | 4 677 | 0,14 | Legal & General Group PLC 5,625 % éch. 24/03/2031 (h)(j) | € | 800 | 868 | 0,03 |
| | | | | | 1,500 % éch. 27/09/2031 | | 1 700 | 1 467 | 0,04 | LFS Topco LLC 5,875 % éch. 15/10/2026 | \$ | 1 500 | 1 382 | 0,04 |
| | | | | | Deutsche Bank AG 0,898 % éch. 28/05/2024 (k) | \$ | 1 900 | 1 866 | 0,05 | Lloyds Banking Group PLC 4,375 % éch. 22/03/2028 | | 900 | 881 | 0,03 |
| | | | | | 1,375 % éch. 17/02/2032 | € | 4 600 | 4 183 | 0,12 | 4,947 % éch. 27/06/2025 (h)(j) | € | 1 100 | 1 188 | 0,03 |
| | | | | | 1,625 % éch. 20/01/2027 | | 1 900 | 1 974 | 0,06 | 4,976 % éch. 11/08/2033 | \$ | 2 900 | 2 827 | 0,08 |
| | | | | | 2,625 % éch. 16/12/2024 | € | 1 200 | 1 483 | 0,04 | Logicor Financing SARL 0,625 % éch. 17/11/2025 | € | 300 | 309 | 0,01 |
| | | | | | 3,035 % éch. 28/05/2032 (k) | \$ | 800 | 669 | 0,02 | 1,500 % éch. 13/07/2026 | | 2 300 | 2 383 | 0,07 |
| | | | | | 3,742 % éch. 07/01/2033 | | 1 200 | 986 | 0,03 | 1,625 % éch. 17/01/2030 | | 900 | 853 | 0,02 |
| | | | | | 3,875 % éch. 12/02/2024 | € | 3 500 | 4 451 | 0,13 | 2,000 % éch. 17/01/2034 | | 1 000 | 867 | 0,03 |
| | | | | | | | | | | 2,750 % éch. 15/01/2030 | € | 900 | 946 | 0,03 |
| | | | | | | | | | | Mizuho Financial Group, Inc. 0,470 % éch. 06/09/2029 | € | 3 000 | 2 867 | 0,08 |
| | | | | | | | | | | 2,564 % éch. 13/09/2031 | \$ | 1 600 | 1 303 | 0,04 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Morgan Stanley | | | | UniCredit SpA | | | | 4,908 % éch. 23/07/2025 | \$ 2 970 | \$ 2 943 | 0,09 |
| 0,000 % éch. 02/04/2032 (k) | \$ 3 600 | \$ 2 188 | 0,06 | 2,569 % éch. 22/09/2026 | \$ 350 | \$ 329 | 0,01 | 6,384 % éch. 23/10/2035 | 875 | 889 | 0,03 |
| Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal | | | | VICI Properties LP | | | | 6,484 % éch. 23/10/2045 | 1 100 | 1 082 | 0,03 |
| 0,625 % éch. 21/06/2027 | € 1 200 | 1 203 | 0,03 | 3,500 % éch. 15/02/2025 | 1 700 | 1 658 | 0,05 | 6,834 % éch. 23/10/2055 | 150 | 150 | 0,00 |
| 2,125 % éch. 21/06/2052 | 3 400 | 2 904 | 0,08 | 3,750 % éch. 15/02/2027 | 3 300 | 3 117 | 0,09 | Cloud Software Group, Inc. | | | |
| National Bank of Canada | | | | 4,125 % éch. 15/08/2030 | 2 500 | 2 280 | 0,07 | 6,500 % éch. 31/03/2029 | 3 800 | 3 622 | 0,10 |
| 3,500 % éch. 25/04/2028 | 1 800 | 2 037 | 0,06 | 4,750 % éch. 15/02/2028 | 2 300 | 2 253 | 0,07 | Constellation Oil Services Holding S.A. | | | |
| Nationwide Building Society | | | | Virgin Money UK PLC | | | | 13,500 % éch. 30/06/2025 | 314 | 311 | 0,01 |
| 3,960 % éch. 18/07/2030 | \$ 900 | 841 | 0,02 | 3,375 % éch. 24/04/2026 | € 200 | 244 | 0,01 | Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) | | | |
| 4,302 % éch. 08/03/2029 | 6 800 | 6 521 | 0,19 | Volkswagen Financial Services NV | | | | 3,000 % éch. 31/12/2026 (c) | 954 | 694 | 0,02 |
| 5,875 % éch. 20/12/2024 (h)(j) | € 1 600 | 2 007 | 0,06 | 0,875 % éch. 20/02/2025 | 3 200 | 3 875 | 0,11 | Coty, Inc. | | | |
| NatWest Group PLC | | | | Wells Fargo & Co. | | | | 3,875 % éch. 15/04/2026 | € 4 200 | 4 642 | 0,13 |
| 2,000 % éch. 04/03/2025 | € 4 500 | 4 952 | 0,14 | 3,000 % éch. 22/04/2026 | \$ 2 100 | 2 012 | 0,06 | 4,750 % éch. 15/01/2029 | \$ 2 000 | 1 909 | 0,06 |
| 4,892 % éch. 18/05/2029 | \$ 1 700 | 1 671 | 0,05 | 3,526 % éch. 24/03/2028 | 2 600 | 2 482 | 0,07 | DAE Funding LLC | | | |
| 5,125 % éch. 12/05/2027 (h)(j) | € 200 | 230 | 0,01 | 6,303 % éch. 23/10/2029 | 6 100 | 6 433 | 0,19 | 1,625 % éch. 15/02/2024 | 2 500 | 2 487 | 0,07 |
| NatWest Markets PLC | | | | Wells Fargo Bank N.A. | | | | DISH DBS Corp. | | | |
| 1,000 % éch. 28/05/2024 | € 1 700 | 1 856 | 0,05 | 5,254 % éch. 11/12/2026 | 8 000 | 8 101 | 0,23 | 5,250 % éch. 01/12/2026 | 1 000 | 859 | 0,02 |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC | | | | Workspace Group PLC | | | | 5,750 % éch. 01/12/2028 | 2 000 | 1 599 | 0,05 |
| 1,850 % éch. 16/09/2026 | \$ 1 600 | 1 440 | 0,04 | 2,250 % éch. 11/03/2028 | € 2 700 | 2 956 | 0,09 | DISH Network Corp. | | | |
| 2,000 % éch. 09/03/2026 | 1 400 | 1 287 | 0,04 | WPC Eurobond BV | | | | 11,750 % éch. 15/11/2027 | 6 400 | 6 686 | 0,19 |
| 2,450 % éch. 15/09/2028 | 700 | 600 | 0,02 | 1,350 % éch. 15/04/2028 | € 1 700 | 1 720 | 0,05 | Exela Intermediate LLC | | | |
| Nova Ljubljanska Banka d.d. | | | | | | | | 11,500 % éch. 15/04/2026 | 953 | 171 | 0,00 |
| 3,400 % éch. 05/02/2030 (l) | € 2 500 | 2 397 | 0,07 | INDUSTRIE | | | | Expedia Group, Inc. | | | |
| 3,650 % éch. 19/11/2029 | 2 900 | 2 821 | 0,08 | AA Bond Co. Ltd. | | | | 2,950 % éch. 15/03/2031 | 540 | 476 | 0,01 |
| Nuveen Finance LLC | | | | 3,250 % éch. 31/07/2050 | € 2 300 | 2 495 | 0,07 | 6,250 % éch. 01/05/2025 | 2 069 | 2 090 | 0,06 |
| 4,125 % éch. 01/11/2024 | \$ 500 | 493 | 0,01 | Accor S.A. | | | | Ford Motor Co. | | | |
| Park Aerospace Holdings Ltd. | | | | 2,375 % éch. 29/11/2028 | € 3 500 | 3 696 | 0,11 | 3,250 % éch. 12/02/2032 | 1 300 | 1 082 | 0,03 |
| 5,500 % éch. 15/02/2024 | 28 | 28 | 0,00 | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. | | | | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | | | |
| PRA Group, Inc. | | | | 3,100 % éch. 02/02/2031 | \$ 5 000 | 3 820 | 0,11 | 2,125 % éch. 09/07/2027 | € 1 900 | 2 044 | 0,06 |
| 7,375 % éch. 01/09/2025 | 1 100 | 1 095 | 0,03 | 3,375 % éch. 24/07/2024 | 409 | 401 | 0,01 | Global Payments, Inc. | | | |
| Prologis International Funding S.A. | | | | Aeroporti di Roma SpA | | | | 5,300 % éch. 15/08/2029 | \$ 1 800 | 1 813 | 0,05 |
| 3,125 % éch. 01/06/2031 | € 2 200 | 2 353 | 0,07 | 1,750 % éch. 30/07/2031 | € 3 800 | 3 631 | 0,11 | GN Store Nord A/S | | | |
| RLJ Lodging Trust LP | | | | Air Canada | | | | 0,875 % éch. 25/11/2024 | € 3 400 | 3 600 | 0,10 |
| 3,750 % éch. 01/07/2026 | \$ 1 600 | 1 517 | 0,04 | 3,875 % éch. 15/08/2026 | \$ 1 300 | 1 243 | 0,04 | Grifols S.A. | | | |
| Sagax AB | | | | Air Canada Pass-Through Trust | | | | 3,875 % éch. 15/10/2028 | 3 100 | 3 138 | 0,09 |
| 1,125 % éch. 30/01/2027 | € 3 800 | 3 783 | 0,11 | 3,600 % éch. 15/09/2028 | 996 | 938 | 0,03 | Haleon U.S. Capital LLC | | | |
| 2,000 % éch. 17/01/2024 | 190 | 210 | 0,01 | Alaska Airlines Pass-Through Trust | | | | 3,375 % éch. 24/03/2029 | \$ 1 850 | 1 751 | 0,05 |
| 2,250 % éch. 13/03/2025 | 2 200 | 2 366 | 0,07 | 4,800 % éch. 15/02/2029 | 841 | 819 | 0,02 | Haleon UK Capital PLC | | | |
| Sagax Euro MTN NL BV | | | | Allegiant Travel Co. | | | | 3,125 % éch. 24/03/2025 | 3 000 | 2 931 | 0,09 |
| 0,750 % éch. 26/01/2028 (l) | 2 200 | 2 080 | 0,06 | 7,250 % éch. 15/08/2027 | 2 600 | 2 547 | 0,07 | HCA, Inc. | | | |
| 1,000 % éch. 17/05/2029 | 1 200 | 1 086 | 0,03 | Altice France S.A. | | | | 5,375 % éch. 01/09/2026 | 900 | 905 | 0,03 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | 4,250 % éch. 15/10/2029 | € 2 300 | 2 029 | 0,06 | Hilton Domestic Operating Co., Inc. | | | |
| 3,823 % éch. 03/11/2028 | \$ 3 100 | 2 916 | 0,08 | 5,500 % éch. 15/10/2029 | \$ 2 500 | 1 963 | 0,06 | 3,750 % éch. 01/05/2029 | 300 | 278 | 0,01 |
| 6,750 % éch. 24/06/2024 (h)(j) | € 400 | 510 | 0,01 | 11,500 % éch. 01/02/2027 (b)(k) | € 2 010 | 2 237 | 0,06 | 4,000 % éch. 01/05/2031 | 3 200 | 2 934 | 0,09 |
| 7,482 % éch. 29/08/2029 | 5 400 | 7 492 | 0,22 | AMC Networks, Inc. | | | | Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC | | | |
| SELP Finance SARL | | | | 4,750 % éch. 01/08/2025 | \$ 1 700 | 1 657 | 0,05 | 5,000 % éch. 01/06/2029 | 4 000 | 3 695 | 0,11 |
| 3,750 % éch. 10/08/2027 | € 3 300 | 3 652 | 0,11 | American Airlines Pass-Through Trust | | | | Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement | | | |
| Sirius Real Estate Ltd. | | | | 3,000 % éch. 15/04/2030 | 403 | 365 | 0,01 | 0,125 % éch. 16/09/2025 | € 1 600 | 1 663 | 0,05 |
| 1,125 % éch. 22/06/2026 | 4 800 | 4 795 | 0,14 | 3,250 % éch. 15/04/2030 | 135 | 118 | 0,00 | 0,625 % éch. 16/09/2028 | 2 200 | 2 118 | 0,06 |
| Société Générale S.A. | | | | 3,350 % éch. 15/04/2031 | 773 | 699 | 0,02 | IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature) | | | |
| 4,677 % éch. 15/06/2027 | \$ 3 700 | 3 668 | 0,11 | 3,375 % éch. 01/11/2028 | 920 | 844 | 0,02 | 3,750 % éch. 15/09/2026 (c) | 3 200 | 3 495 | 0,10 |
| Sofina S.A. | | | | 3,575 % éch. 15/07/2029 | 934 | 872 | 0,03 | Imperial Brands Finance Netherlands BV | | | |
| 1,000 % éch. 23/09/2028 | € 2 900 | 2 705 | 0,08 | 3,700 % éch. 01/04/2028 | 158 | 148 | 0,00 | 1,750 % éch. 18/03/2033 | 1 700 | 1 473 | 0,04 |
| Spirit Realty LP | | | | American Airlines, Inc. | | | | Intelsat Jackson Holdings S.A. | | | |
| 4,000 % éch. 15/07/2029 | \$ 400 | 380 | 0,01 | 5,500 % éch. 20/04/2026 | 1 083 | 1 076 | 0,03 | 6,500 % éch. 15/03/2030 | \$ 1 406 | 1 343 | 0,04 |
| Stichting AK Rabobank Certificaten | | | | 5,750 % éch. 20/04/2029 | 3 900 | 3 806 | 0,11 | JetBlue Pass-Through Trust | | | |
| 6,500 % (h) | € 1 996 | 2 214 | 0,06 | Becton Dickinson Euro Finance SARL | | | | 2,750 % éch. 15/11/2033 | 163 | 138 | 0,00 |
| STORE Capital Corp. | | | | 1,336 % éch. 13/08/2041 | € 3 100 | 2 368 | 0,07 | Kraft Heinz Foods Co. | | | |
| 4,625 % éch. 15/03/2029 | \$ 200 | 185 | 0,01 | Boeing Co. | | | | 5,000 % éch. 15/07/2035 | 73 | 73 | 0,00 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | | 1,950 % éch. 01/02/2024 | \$ 700 | 698 | 0,02 | Las Vegas Sands Corp. | | | |
| 3,629 % éch. 06/04/2026 | € 3 300 | 3 677 | 0,11 | 2,750 % éch. 01/02/2026 | 5 100 | 4 883 | 0,14 | 3,900 % éch. 08/08/2029 | 200 | 185 | 0,01 |
| Synchrony Financial | | | | British Airways Pass-Through Trust | | | | Melco Resorts Finance Ltd. | | | |
| 4,500 % éch. 23/07/2025 | \$ 800 | 782 | 0,02 | 2,900 % éch. 15/09/2036 | 1 480 | 1 268 | 0,04 | 5,375 % éch. 04/12/2029 | 200 | 177 | 0,01 |
| 5,150 % éch. 19/03/2029 | 9 000 | 8 754 | 0,25 | 4,250 % éch. 15/05/2034 | 650 | 607 | 0,02 | Mileage Plus Holdings LLC | | | |
| Toronto-Dominion Bank | | | | Broadcom, Inc. | | | | 6,500 % éch. 20/06/2027 | 4 620 | 4 637 | 0,13 |
| 3,879 % éch. 13/03/2026 | € 23 400 | 26 324 | 0,76 | 3,137 % éch. 15/11/2035 | 4 | 3 | 0,00 | MPH Acquisition Holdings LLC | | | |
| TP ICAP Finance PLC | | | | 4,926 % éch. 15/05/2037 | 4 | 4 | 0,00 | 5,500 % éch. 01/09/2028 | 3 300 | 2 959 | 0,09 |
| 2,625 % éch. 18/11/2028 | € 1 200 | 1 281 | 0,04 | Caesars Entertainment, Inc. | | | | Mundys SpA | | | |
| 5,250 % éch. 29/05/2026 | 3 500 | 4 327 | 0,13 | 6,250 % éch. 01/07/2025 | 400 | 401 | 0,01 | 1,875 % éch. 12/02/2028 | € 10 100 | 10 277 | 0,30 |
| UBS Group AG | | | | Carnival Holdings Bermuda Ltd. | | | | Nidec Corp. | | | |
| 3,091 % éch. 14/05/2032 | \$ 950 | 810 | 0,02 | 10,375 % éch. 01/05/2028 | 2 500 | 2 723 | 0,08 | 0,046 % éch. 30/03/2026 | 1 100 | 1 122 | 0,03 |
| 3,869 % éch. 12/01/2029 | 4 750 | 4 482 | 0,13 | CCO Holdings LLC | | | | Nissan Motor Co. Ltd. | | | |
| 4,194 % éch. 01/04/2031 | 2 100 | 1 957 | 0,06 | 5,000 % éch. 01/02/2028 | 1 550 | 1 484 | 0,04 | 3,522 % éch. 17/09/2025 | \$ 7 500 | 7 224 | 0,21 |
| 4,375 % éch. 10/02/2031 (h)(j) | 1 300 | 1 030 | 0,03 | Charter Communications Operating LLC | | | | 4,345 % éch. 17/09/2027 | 1 700 | 1 628 | 0,05 |
| 6,442 % éch. 11/08/2028 | 4 750 | 4 936 | 0,14 | 3,500 % éch. 01/06/2041 | 2 000 | 1 415 | 0,04 | 4,810 % éch. 17/09/2030 | 500 | 468 | 0,01 |
| 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 400 | 510 | 0,01 | 3,900 % éch. 01/06/2052 | 1 900 | 1 280 | 0,04 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Banc of America Funding Trust | | | | Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates | | | | 5,800 % éch. 25/02/2035 | \$ 34 | \$ 28 | 0,00 |
| 3,395 % éch. 20/10/2046 | \$ 69 | \$ 58 | 0,00 | 5,650 % éch. 25/05/2036 | \$ 25 | \$ 22 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/05/2035 | 35 | 28 | 0,00 |
| 4,306 % éch. 20/06/2037 | 53 | 44 | 0,00 | Citicorp Mortgage Securities Trust | | | | 6,000 % éch. 25/09/2037 | 83 | 41 | 0,00 |
| 4,379 % éch. 20/05/2036 | 147 | 126 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/09/2037 | 25 | 24 | 0,00 | 6,050 % éch. 25/04/2035 | 24 | 22 | 0,00 |
| 4,410 % éch. 20/12/2034 | 11 | 8 | 0,00 | Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc. | | | | 6,050 % éch. 25/04/2035 | 14 | 12 | 0,00 |
| 4,732 % éch. 20/04/2035 | 768 | 685 | 0,02 | 5,970 % éch. 25/05/2032 | 26 | 25 | 0,00 | 6,110 % éch. 25/03/2035 | 256 | 221 | 0,01 |
| 4,982 % éch. 20/06/2036 | 11 | 9 | 0,00 | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | 6,130 % éch. 25/02/2035 | 3 | 2 | 0,00 |
| 5,061 % éch. 20/01/2047 | 360 | 308 | 0,01 | 3,772 % éch. 25/10/2046 | 290 | 258 | 0,01 | 6,210 % éch. 25/02/2035 | 755 | 643 | 0,02 |
| 5,404 % éch. 20/11/2034 | 356 | 323 | 0,01 | 4,318 % éch. 25/03/2034 | 65 | 58 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/12/2037 | 1 430 | 615 | 0,02 |
| 5,490 % éch. 20/02/2036 | 82 | 76 | 0,00 | 4,504 % éch. 25/07/2037 | 8 | 7 | 0,00 | 7,884 % éch. 20/02/2036 | 23 | 19 | 0,00 |
| 5,530 % éch. 25/01/2037 | 97 | 84 | 0,00 | 5,322 % éch. 25/08/2035 | 38 | 36 | 0,00 | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust | | | |
| 5,792 % éch. 20/02/2047 | 585 | 600 | 0,02 | 5,720 % éch. 25/09/2037 | 77 | 68 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/11/2034 | 13 | 12 | 0,00 |
| 5,852 % éch. 20/07/2036 | 3 051 | 2 982 | 0,09 | 6,980 % éch. 25/05/2035 | 42 | 41 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/03/2035 | 368 | 360 | 0,01 |
| 5,852 % éch. 20/12/2046 | 193 | 158 | 0,01 | 7,860 % éch. 25/11/2035 | 66 | 65 | 0,00 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | |
| 6,270 % éch. 25/05/2037 | 568 | 474 | 0,01 | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | 6,000 % éch. 25/01/2036 | 480 | 297 | 0,01 |
| Banc of America Mortgage Trust | | | | 4,429 % éch. 25/02/2034 | 7 | 7 | 0,00 | 6,050 % éch. 25/03/2032 | 25 | 23 | 0,00 |
| 3,815 % éch. 25/02/2035 | 57 | 54 | 0,00 | 6,277 % éch. 25/09/2035 | 1 | 1 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/04/2033 | 3 | 3 | 0,00 |
| 4,397 % éch. 25/05/2035 | 216 | 191 | 0,01 | CitiMortgage Alternative Loan Trust | | | | Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through | | | |
| 4,578 % éch. 25/06/2035 | 44 | 39 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/09/2036 | 1 444 | 1 191 | 0,04 | Certificates | | | |
| 5,033 % éch. 25/01/2035 | 24 | 23 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/01/2037 | 1 064 | 868 | 0,03 | 6,401 % éch. 25/10/2033 | 6 | 6 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 20/07/2032 | 0 | 0 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/06/2037 | 1 545 | 1 284 | 0,04 | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates | | | |
| BCAP LLC Trust | | | | 6,000 % éch. 25/10/2037 | 663 | 588 | 0,02 | 3,193 % éch. 30/11/2037 | 3 549 | 3 219 | 0,09 |
| 3,790 % éch. 26/11/2036 | 1 300 | 1 316 | 0,04 | Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust | | | | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust | | | |
| 4,533 % éch. 26/03/2037 | 1 145 | 1 625 | 0,05 | 6,000 % éch. 25/05/2036 | 95 | 54 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/02/2037 | 3 699 | 1 679 | 0,05 |
| 5,250 % éch. 26/02/2036 | 560 | 241 | 0,01 | Countrywide Alternative Loan Trust | | | | 6,250 % éch. 25/08/2036 | 42 | 17 | 0,00 |
| 5,250 % éch. 26/06/2036 | 12 620 | 5 321 | 0,15 | 0,000 % éch. 25/12/2035 (a) | 1 074 | 72 | 0,00 | 7,000 % éch. 25/08/2037 | 371 | 192 | 0,01 |
| 5,250 % éch. 26/04/2037 | 606 | 347 | 0,01 | 5,000 % éch. 25/03/2035 | 5 | 4 | 0,00 | Credit Suisse Mortgage Capital Trust | | | |
| 5,250 % éch. 26/06/2037 | 126 | 113 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/04/2035 | 118 | 82 | 0,00 | 4,146 % éch. 25/06/2050 | 1 756 | 1 499 | 0,04 |
| 5,810 % éch. 25/01/2037 | 1 821 | 1 692 | 0,05 | 5,500 % éch. 25/09/2035 | 230 | 139 | 0,00 | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,830 % éch. 25/03/2037 | 701 | 603 | 0,02 | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 169 | 100 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/07/2047 | 366 | 336 | 0,01 |
| 6,770 % éch. 25/09/2047 | 861 | 744 | 0,02 | 5,500 % éch. 25/12/2035 | 4 250 | 2 472 | 0,07 | 5,770 % éch. 25/03/2037 | 227 | 203 | 0,01 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | | | | 5,500 % éch. 25/01/2036 | 20 | 12 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/09/2047 | 663 | 564 | 0,02 |
| 3,250 % éch. 25/02/2033 | 1 | 0 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/05/2036 | 398 | 310 | 0,01 | 5,800 % éch. 25/08/2037 | 1 353 | 1 071 | 0,03 |
| 3,877 % éch. 25/05/2047 | 558 | 500 | 0,01 | 5,652 % éch. 20/02/2047 | 304 | 235 | 0,01 | Downey Savings & Loan Association Mortgage | | | |
| 3,974 % éch. 25/09/2034 | 249 | 229 | 0,01 | 5,662 % éch. 20/03/2047 | 4 848 | 3 971 | 0,12 | Loan Trust | | | |
| 4,746 % éch. 25/07/2034 | 42 | 39 | 0,00 | 5,667 % éch. 20/12/2046 | 10 496 | 9 031 | 0,26 | 5,660 % éch. 19/10/2036 | 595 | 491 | 0,01 |
| 4,828 % éch. 25/04/2033 | 5 | 5 | 0,00 | 5,670 % éch. 25/04/2047 | 184 | 173 | 0,01 | 6,046 % éch. 19/07/2044 | 174 | 159 | 0,00 |
| 4,892 % éch. 25/01/2035 | 248 | 236 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/02/2035 | 134 | 93 | 0,00 | Dutch Property Finance BV | | | |
| 5,030 % éch. 25/08/2035 | 45 | 41 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/07/2035 | 660 | 416 | 0,01 | 4,602 % éch. 28/07/2054 | € 1 184 | 1 307 | 0,04 |
| 5,224 % éch. 25/11/2034 | 35 | 32 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/05/2036 | 433 | 173 | 0,01 | EMF-NL Prime BV | | | |
| 5,308 % éch. 25/04/2033 | 3 | 3 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/03/2037 | 378 | 208 | 0,01 | 4,785 % éch. 17/04/2041 | 1 011 | 1 073 | 0,03 |
| 5,710 % éch. 25/11/2034 | 37 | 31 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/06/2037 | 640 | 568 | 0,02 | European Loan Conduit DAC | | | |
| 5,820 % éch. 25/01/2034 | 33 | 33 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/04/2047 | 1 175 | 1 034 | 0,03 | 4,994 % éch. 19/02/2030 | 4 109 | 4 480 | 0,13 |
| 6,055 % éch. 25/08/2033 | 93 | 89 | 0,00 | 5,752 % éch. 20/09/2046 | 566 | 414 | 0,01 | Eurosail BV | | | |
| 6,136 % éch. 25/01/2035 | 34 | 31 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/09/2047 | 541 | 489 | 0,01 | 5,485 % éch. 17/10/2040 | 59 | 65 | 0,00 |
| 6,239 % éch. 25/01/2035 | 18 | 17 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/05/2047 | 548 | 467 | 0,01 | Eurosail PLC | | | |
| Bear Stearns ALT-A Trust | | | | 5,830 % éch. 25/05/2047 | 754 | 642 | 0,02 | 4,208 % éch. 13/03/2045 | 3 632 | 3 785 | 0,11 |
| 3,250 % éch. 25/02/2034 | 8 | 7 | 0,00 | 5,840 % éch. 25/02/2037 | 1 936 | 682 | 0,02 | 5,589 % éch. 13/03/2045 | £ 7 250 | 8 717 | 0,25 |
| 3,905 % éch. 25/04/2035 | 44 | 38 | 0,00 | 5,850 % éch. 25/07/2046 | 290 | 286 | 0,01 | 5,819 % éch. 10/06/2044 | 4 816 | 6 000 | 0,17 |
| 3,971 % éch. 25/05/2036 | 486 | 238 | 0,01 | 5,850 % éch. 25/09/2046 | 16 | 15 | 0,00 | 6,289 % éch. 13/06/2045 | 10 049 | 12 435 | 0,36 |
| 4,189 % éch. 25/09/2035 | 3 846 | 1 648 | 0,05 | 5,892 % éch. 20/03/2046 | 48 | 39 | 0,00 | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust | | | |
| 4,196 % éch. 25/11/2036 | 1 120 | 502 | 0,02 | 5,892 % éch. 20/05/2046 | 289 | 244 | 0,01 | 5,029 % éch. 25/01/2036 | \$ 313 | 165 | 0,01 |
| 4,228 % éch. 25/11/2036 | 3 112 | 1 722 | 0,05 | 5,950 % éch. 25/01/2037 | 2 053 | 1 675 | 0,05 | 5,754 % éch. 25/09/2034 | 31 | 29 | 0,00 |
| 4,240 % éch. 25/03/2036 | 222 | 177 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/10/2035 | 1 264 | 902 | 0,03 | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust | | | |
| 4,488 % éch. 25/05/2035 | 284 | 267 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/04/2036 | 782 | 385 | 0,01 | 5,464 % éch. 25/08/2035 | 24 | 17 | 0,00 |
| 4,816 % éch. 25/09/2034 | 83 | 76 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/07/2036 | 535 | 195 | 0,01 | Friary PLC | | | |
| 5,679 % éch. 25/01/2034 | 40 | 35 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/08/2036 | 119 | 71 | 0,00 | 5,940 % éch. 21/11/2067 | £ 513 | 655 | 0,02 |
| 5,790 % éch. 25/02/2034 | 127 | 118 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/12/2036 | 1 240 | 523 | 0,02 | GMAC Mortgage Corp. Loan Trust | | | |
| 5,810 % éch. 25/08/2036 | 176 | 162 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/02/2037 | 226 | 99 | 0,00 | 3,357 % éch. 19/04/2036 | \$ 45 | 35 | 0,00 |
| 5,870 % éch. 25/02/2034 | 630 | 570 | 0,02 | 6,000 % éch. 25/03/2037 | 287 | 110 | 0,00 | Great Hall Mortgages PLC | | | |
| 5,910 % éch. 25/04/2036 | 399 | 352 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 554 | 268 | 0,01 | 5,812 % éch. 18/06/2039 | 11 | 11 | 0,00 |
| 5,950 % éch. 25/02/2036 | 283 | 250 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 92 | 45 | 0,00 | Greenpoint Mortgage Funding Trust | | | |
| Bear Stearns Mortgage Funding Trust | | | | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 643 | 334 | 0,01 | 6,010 % éch. 25/11/2045 | 137 | 120 | 0,00 |
| 5,650 % éch. 25/06/2037 | 574 | 529 | 0,02 | 6,012 % éch. 25/12/2035 | 2 077 | 1 723 | 0,05 | 6,090 % éch. 25/10/2045 | 12 | 11 | 0,00 |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust | | | | 6,030 % éch. 25/02/2037 | 718 | 579 | 0,02 | GSR Mortgage Loan Trust | | | |
| 3,993 % éch. 26/12/2046 | 420 | 317 | 0,01 | 6,050 % éch. 25/02/2036 | 1 651 | 1 459 | 0,04 | 1,180 % éch. 25/01/2037 (a) | 3 066 | 296 | 0,01 |
| Canada Square Funding PLC | | | | 6,112 % éch. 20/11/2035 | 20 | 17 | 0,00 | 4,511 % éch. 25/11/2035 | 52 | 46 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 17/01/2059 | £ 2 064 | 2 615 | 0,08 | 6,370 % éch. 25/12/2036 | 639 | 230 | 0,01 | 4,836 % éch. 25/09/2035 | 127 | 120 | 0,00 |
| Charter Mortgage Funding PLC | | | | 6,500 % éch. 25/08/2032 | 39 | 38 | 0,00 | 4,976 % éch. 25/11/2035 | 90 | 50 | 0,00 |
| 5,796 % éch. 16/01/2057 | 1 185 | 1 511 | 0,04 | 6,500 % éch. 25/09/2037 | 554 | 215 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/03/2036 | 9 | 8 | 0,00 |
| Chase Mortgage Finance Trust | | | | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | 5,750 % éch. 25/01/2037 | 18 | 11 | 0,00 |
| 3,847 % éch. 25/03/2037 | \$ 316 | 292 | 0,01 | 3,673 % éch. 20/05/2036 | 629 | 587 | 0,02 | 6,000 % éch. 25/03/2032 | 0 | 0 | 0,00 |
| 4,114 % éch. 25/03/2037 | 26 | 24 | 0,00 | 3,695 % éch. 25/04/2035 | 28 | 20 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/11/2035 | 828 | 325 | 0,01 |
| 5,342 % éch. 25/02/2037 | 13 | 13 | 0,00 | 4,039 % éch. 20/05/2036 | 340 | 313 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/03/2037 | 47 | 26 | 0,00 |
| ChaseFlex Trust | | | | 4,110 % éch. 20/02/2036 | 455 | 400 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 118 | 85 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 25/07/2037 | 11 | 9 | 0,00 | 4,241 % éch. 20/07/2034 | 73 | 67 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/09/2036 | 79 | 38 | 0,00 |
| ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through | | | | 5,250 % éch. 25/12/2027 | 21 | 13 | 0,00 | HarborView Mortgage Loan Trust | | | |
| Certificates Trust | | | | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 4 | 2 | 0,00 | 3,685 % éch. 19/10/2033 | 27 | 23 | 0,00 |
| 4,204 % éch. 25/08/2037 | 540 | 423 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/02/2037 | 356 | 162 | 0,01 | 4,935 % éch. 19/06/2045 | 1 099 | 545 | 0,02 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Accunia European CLO DAC | | | | BNPP AM Euro CLO DAC | | | | Delta Funding Home Equity Loan Trust | | | |
| 4,895 % éch. 15/10/2030 € | 1 539 | 1 699 | 0,05 | 4,615 % éch. 15/10/2031 € | 1 477 | 1 611 | 0,05 | 6,296 % éch. 15/09/2029 \$ | 4 | 4 | 0,00 |
| 4,915 % éch. 15/07/2030 | 2 556 | 2 821 | 0,08 | 4,822 % éch. 22/07/2032 | 5 800 | 6 324 | 0,18 | Dryden Euro CLO DAC | | | |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | Bosphorus CLO DAC | | | | 4,625 % éch. 15/04/2033 € | 8 854 | 9 638 | 0,28 |
| 5,710 % éch. 25/08/2036 \$ | 1 521 | 371 | 0,01 | 4,745 % éch. 15/12/2030 | 813 | 890 | 0,03 | 4,862 % éch. 15/05/2034 | 5 790 | 6 299 | 0,18 |
| 6,295 % éch. 25/12/2045 | 951 | 721 | 0,02 | 4,960 % éch. 12/12/2032 | 3 400 | 3 711 | 0,11 | 4,965 % éch. 17/01/2033 | 5 000 | 5 441 | 0,16 |
| Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | Cairn CLO BV | | | | EMC Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,940 % éch. 25/11/2035 | 2 714 | 2 639 | 0,08 | 4,745 % éch. 15/10/2031 | 5 296 | 5 755 | 0,17 | 6,210 % éch. 25/05/2040 \$ | 92 | 91 | 0,00 |
| 6,340 % éch. 25/01/2036 | 600 | 567 | 0,02 | Cairn CLO DAC | | | | Euro-Galaxy CLO DAC | | | |
| 6,490 % éch. 25/09/2034 | 1 085 | 1 068 | 0,03 | 4,552 % éch. 30/04/2031 | 2 082 | 2 273 | 0,07 | 4,589 % éch. 24/04/2034 € | 3 796 | 4 120 | 0,12 |
| AMMC CLO Ltd. | | | | 4,618 % éch. 31/01/2030 | 3 632 | 3 976 | 0,12 | Fieldstone Mortgage Investment Trust | | | |
| 6,894 % éch. 02/11/2030 | 1 677 | 1 679 | 0,05 | Carlyle Euro CLO DAC | | | | 5,777 % éch. 25/11/2036 \$ | 1 129 | 654 | 0,02 |
| Amortizing Residential Collateral Trust | | | | 4,632 % éch. 15/08/2030 | 1 282 | 1 403 | 0,04 | 6,137 % éch. 25/04/2047 | 3 741 | 2 622 | 0,08 |
| 6,170 % éch. 25/10/2031 | 20 | 19 | 0,00 | 4,665 % éch. 15/01/2031 | 6 445 | 7 051 | 0,20 | First Franklin Mortgage Loan Trust | | | |
| Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC | | | | 5,750 % éch. 25/12/2036 | 1 104 | 451 | 0,01 |
| 6,410 % éch. 25/06/2029 | 6 | 5 | 0,00 | 4,925 % éch. 16/01/2033 | 5 600 | 6 091 | 0,18 | 6,070 % éch. 25/07/2035 | 1 762 | 1 735 | 0,05 |
| Aqueduct European CLO DAC | | | | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | | 6,190 % éch. 25/11/2035 | 1 260 | 1 164 | 0,03 |
| 4,633 % éch. 20/07/2030 € | 1 905 | 2 089 | 0,06 | 4,752 % éch. 15/11/2031 | 11 079 | 12 070 | 0,35 | First NLC Trust | | | |
| Ares European CLO DAC | | | | Carrington Mortgage Loan Trust | | | | 5,650 % éch. 25/08/2037 | 6 819 | 3 390 | 0,10 |
| 4,843 % éch. 20/04/2032 | 2 900 | 3 153 | 0,09 | 5,630 % éch. 25/10/2036 \$ | 2 427 | 2 356 | 0,07 | Fremont Home Loan Trust | | | |
| 5,122 % éch. 21/10/2033 | 8 500 | 9 294 | 0,27 | 5,720 % éch. 25/10/2036 | 900 | 698 | 0,02 | 5,600 % éch. 25/11/2036 | 1 844 | 639 | 0,02 |
| Argent Securities Trust | | | | 5,950 % éch. 25/06/2036 | 966 | 917 | 0,03 | 5,605 % éch. 25/10/2036 | 3 295 | 2 893 | 0,08 |
| 5,620 % éch. 25/09/2036 \$ | 2 005 | 644 | 0,02 | 6,370 % éch. 25/05/2034 | 388 | 384 | 0,01 | 5,670 % éch. 25/08/2036 | 606 | 195 | 0,01 |
| 5,690 % éch. 25/05/2036 | 534 | 130 | 0,00 | Centex Home Equity Loan Trust | | | | 5,750 % éch. 25/02/2037 | 7 004 | 5 363 | 0,16 |
| 5,770 % éch. 25/06/2036 | 1 662 | 441 | 0,01 | 6,400 % éch. 25/09/2034 | 291 | 282 | 0,01 | 5,810 % éch. 25/02/2037 | 1 640 | 551 | 0,02 |
| 5,770 % éch. 25/07/2036 | 5 570 | 4 854 | 0,14 | CIT Mortgage Loan Trust | | | | 5,970 % éch. 25/05/2036 | 1 283 | 749 | 0,02 |
| 5,790 % éch. 25/05/2036 | 3 577 | 873 | 0,03 | 6,970 % éch. 25/10/2037 | 10 423 | 10 315 | 0,30 | 6,085 % éch. 25/11/2035 | 5 788 | 5 075 | 0,15 |
| Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | 6,340 % éch. 25/05/2034 | 1 457 | 1 373 | 0,04 |
| 5,950 % éch. 25/05/2035 | 1 907 | 1 608 | 0,05 | 5,640 % éch. 25/07/2045 | 1 302 | 898 | 0,03 | GE-WMC Mortgage Securities Trust | | | |
| Armada Euro CLO DAC | | | | 5,670 % éch. 25/05/2037 | 3 912 | 2 564 | 0,07 | 5,770 % éch. 25/08/2036 | 10 090 | 4 196 | 0,12 |
| 4,685 % éch. 15/07/2031 € | 1 542 | 1 685 | 0,05 | 5,790 % éch. 25/12/2036 | 242 | 158 | 0,00 | GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC | | | |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust | | | | 5,970 % éch. 25/08/2036 | 2 531 | 2 469 | 0,07 | 4,893 % éch. 20/01/2032 € | 2 900 | 3 171 | 0,09 |
| 5,580 % éch. 25/01/2037 \$ | 982 | 563 | 0,02 | 5,990 % éch. 25/09/2036 | 659 | 566 | 0,02 | 5,013 % éch. 20/07/2034 | 3 000 | 3 256 | 0,09 |
| 5,630 % éch. 25/01/2037 | 401 | 230 | 0,01 | 7,250 % éch. 25/05/2036 | 519 | 270 | 0,01 | Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. | | | |
| 6,170 % éch. 25/06/2034 | 685 | 671 | 0,02 | Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 6,656 % éch. 15/09/2037 \$ | 1 561 | 1 559 | 0,05 |
| 6,520 % éch. 25/03/2034 | 345 | 330 | 0,01 | 6,415 % éch. 25/10/2034 | 284 | 273 | 0,01 | GSAA Home Equity Trust | | | |
| Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | 5,590 % éch. 25/05/2036 | 641 | 152 | 0,00 |
| 6,565 % éch. 25/02/2035 | 730 | 749 | 0,02 | 5,730 % éch. 25/03/2037 | 403 | 348 | 0,01 | 5,610 % éch. 25/03/2036 | 2 524 | 864 | 0,03 |
| Aurium CLO DAC | | | | Clarinda Park CLO DAC | | | | 5,985 % éch. 25/06/2036 | 6 244 | 1 658 | 0,05 |
| 4,695 % éch. 16/01/2031 € | 10 376 | 11 338 | 0,33 | 4,902 % éch. 15/02/2034 € | 7 550 | 8 192 | 0,24 | 6,070 % éch. 25/05/2047 | 107 | 65 | 0,00 |
| 4,966 % éch. 23/03/2032 | 10 000 | 10 962 | 0,32 | Contego CLO DAC | | | | 6,370 % éch. 25/08/2037 | 76 | 72 | 0,00 |
| Avoca CLO DAC | | | | 4,642 % éch. 23/01/2030 | 4 186 | 4 558 | 0,13 | 6,502 % éch. 25/11/2036 | 42 | 16 | 0,00 |
| 4,655 % éch. 15/07/2030 | 2 886 | 3 172 | 0,09 | Countrywide Asset-Backed Certificates | | | | GSAMP Trust | | | |
| 4,798 % éch. 12/01/2031 | 2 073 | 2 271 | 0,07 | 6,150 % éch. 25/12/2036 \$ | 87 | 67 | 0,00 | 5,540 % éch. 25/12/2036 | 326 | 154 | 0,00 |
| 4,855 % éch. 15/04/2033 | 3 500 | 3 801 | 0,11 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 5,670 % éch. 25/11/2036 | 2 804 | 1 332 | 0,04 |
| Avoca Static CLO DAC | | | | 4,434 % éch. 25/10/2032 | 711 | 706 | 0,02 | 5,790 % éch. 25/04/2036 | 34 | 21 | 0,00 |
| 5,690 % éch. 15/10/2030 | 500 | 552 | 0,02 | 4,512 % éch. 25/07/2036 | 2 589 | 2 333 | 0,07 | 5,990 % éch. 25/06/2036 | 2 226 | 2 130 | 0,06 |
| Barings CLO Ltd. | | | | 5,610 % éch. 25/06/2035 | 410 | 359 | 0,01 | 6,010 % éch. 25/04/2036 | 533 | 337 | 0,01 |
| 6,605 % éch. 15/04/2031 \$ | 4 777 | 4 773 | 0,14 | 5,610 % éch. 25/07/2037 | 1 170 | 1 064 | 0,03 | Harvest CLO DAC | | | |
| 6,667 % éch. 20/01/2031 | 4 998 | 4 995 | 0,14 | 5,610 % éch. 25/08/2037 | 152 | 137 | 0,00 | 4,566 % éch. 26/06/2030 € | 8 601 | 9 398 | 0,27 |
| Barings Euro CLO DAC | | | | 5,650 % éch. 25/11/2047 | 33 | 37 | 0,00 | Home Equity Asset Trust | | | |
| 4,836 % éch. 25/11/2029 € | 1 008 | 1 112 | 0,03 | 5,670 % éch. 25/09/2037 | 618 | 548 | 0,02 | 6,565 % éch. 25/05/2035 \$ | 127 | 125 | 0,00 |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | | 5,670 % éch. 25/06/2047 | 4 868 | 4 355 | 0,13 | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | |
| 4,724 % éch. 25/07/2036 \$ | 18 | 18 | 0,00 | 5,680 % éch. 25/05/2047 | 1 827 | 1 615 | 0,05 | 5,630 % éch. 25/07/2037 | 771 | 416 | 0,01 |
| 5,031 % éch. 25/11/2035 | 731 | 710 | 0,02 | 5,690 % éch. 25/09/2037 | 230 | 234 | 0,01 | 5,690 % éch. 25/04/2037 | 855 | 648 | 0,02 |
| 5,236 % éch. 25/06/2043 | 42 | 38 | 0,00 | 5,859 % éch. 25/10/2046 | 7 | 8 | 0,00 | 5,710 % éch. 25/04/2037 | 864 | 559 | 0,02 |
| 5,500 % éch. 25/08/2036 | 13 | 13 | 0,00 | 5,910 % éch. 25/09/2047 | 1 615 | 1 556 | 0,05 | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | |
| 5,639 % éch. 25/08/2034 | 42 | 40 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/05/2037 | 219 | 208 | 0,01 | 5,660 % éch. 25/01/2037 | 842 | 586 | 0,02 |
| 5,700 % éch. 25/02/2037 | 3 784 | 3 538 | 0,10 | 6,095 % éch. 25/08/2035 | 95 | 91 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/12/2036 | 4 196 | 1 118 | 0,03 |
| 5,770 % éch. 25/11/2036 | 1 060 | 1 029 | 0,03 | 6,565 % éch. 25/04/2036 | 300 | 284 | 0,01 | 5,910 % éch. 25/12/2036 | 3 810 | 1 009 | 0,03 |
| 6,100 % éch. 25/02/2036 | 1 180 | 1 177 | 0,03 | 7,195 % éch. 25/05/2035 | 646 | 636 | 0,02 | 5,995 % éch. 25/02/2036 | 7 100 | 5 869 | 0,17 |
| 6,325 % éch. 25/07/2034 | 1 411 | 1 365 | 0,04 | 7,420 % éch. 25/08/2035 | 1 485 | 1 329 | 0,04 | 6,250 % éch. 25/01/2036 | 3 968 | 3 276 | 0,09 |
| 6,520 % éch. 25/08/2037 | 89 | 78 | 0,00 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | IXIS Real Estate Capital Trust | | | |
| Belle Haven ABS CDO Ltd. | | | | 5,077 % éch. 25/01/2032 | 2 | 2 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/01/2037 | 272 | 97 | 0,00 |
| 5,156 % éch. 03/11/2044 | 11 399 | 3 486 | 0,10 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC | | | | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | |
| Black Diamond CLO DAC | | | | 3,072 % éch. 25/12/2036 | 554 | 456 | 0,01 | 4,470 % éch. 25/01/2037 | 815 | 431 | 0,01 |
| 4,853 % éch. 20/01/2032 € | 786 | 863 | 0,02 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust | | | | 5,730 % éch. 25/06/2037 | 26 | 26 | 0,00 |
| 4,982 % éch. 15/05/2032 | 5 374 | 5 861 | 0,17 | 3,319 % éch. 25/03/2037 | 9 313 | 3 474 | 0,10 | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 633 | 269 | 0,01 |
| Blackrock European CLO DAC | | | | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust | | | | 5,875 % éch. 25/07/2036 | 2 333 | 2 268 | 0,07 |
| 4,585 % éch. 15/10/2031 | 3 044 | 3 310 | 0,10 | 3,201 % éch. 25/01/2037 | 143 | 45 | 0,00 | Jubilee CLO DAC | | | |
| BlueMountain CLO Ltd. | | | | 3,311 % éch. 25/01/2037 | 139 | 44 | 0,00 | 4,615 % éch. 15/04/2031 € | 3 100 | 3 374 | 0,10 |
| 6,735 % éch. 15/07/2031 \$ | 3 863 | 3 859 | 0,11 | 3,400 % éch. 25/07/2036 | 1 854 | 1 706 | 0,05 | Lehman XS Trust | | | |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | | CSAB Mortgage-Backed Trust | | | | 4,719 % éch. 25/06/2036 \$ | 724 | 682 | 0,02 |
| 1,050 % éch. 15/01/2031 € | 497 | 519 | 0,02 | 6,220 % éch. 25/09/2036 | 3 409 | 1 026 | 0,03 | 5,790 % éch. 25/05/2036 | 1 792 | 1 548 | 0,04 |
| 4,685 % éch. 15/01/2031 | 9 436 | 10 310 | 0,30 | CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | | Long Beach Mortgage Loan Trust | | | |
| 4,795 % éch. 15/04/2034 | 2 200 | 2 385 | 0,07 | 4,555 % éch. 15/09/2031 € | 2 987 | 3 250 | 0,09 | 5,690 % éch. 25/11/2036 | 9 165 | 2 841 | 0,08 |
| | | | | 4,652 % éch. 21/07/2030 | 12 253 | 13 383 | 0,39 | 5,910 % éch. 25/02/2036 | 1 447 | 1 405 | 0,04 |
| | | | | 4,852 % éch. 26/08/2032 | 500 | 546 | 0,02 | 6,070 % éch. 25/02/2036 | 259 | 207 | 0,01 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|---------|----------------------------|---------------------|-------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|--|-----------|----------------------------|---------------------|
| SERVICES FINANCIERS | | | | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | BONS DU TRÉSOR ARGENTIN | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| National Bank of Greece S.A. (d) | 307 710 | \$ 2 139 | 0,06 | (34,368) % éch. | | | | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i) | 770 713 | \$ 7 121 | 0,21 |
| IMMOBILIER | | | | (32,600) % éch. | 26 125 | 92 | 0,00 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (i) | 1 496 908 | 13 846 | 0,40 |
| Adler Group S.A. (d) | 33 602 | 18 | 0,00 | 14/10/2024 (e)(f) | | 341 | 0,01 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (i) | 9 812 414 | 99 302 | 2,88 |
| Adler Group S.A. | 74 405 | 44 | 0,00 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i) | 9 350 727 | 93 177 | 2,71 |
| | | 62 | 0,00 | 10,900 % éch. | | | | | | 213 446 | 6,20 |
| | | 2 865 | 0,08 | 04/01/2024 (e)(f) | HUF 16 036 000 | 46 316 | 1,34 | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| BONS DE SOUSCRIPTION | | | | BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071 (k) | 1 | 0 | 0,00 | 5,363 % éch. | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i) | 1 244 050 | 124 057 | 3,60 |
| TITRES PRIVILÉGIÉS | | | | 11/01/2024 (e)(f) | \$ 198 000 | 197 742 | 5,74 | Total des Fonds d'investissement | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 7 094 | 1 178 | 0,03 | Total des Instruments à court terme | | 244 399 | 7,09 | | | \$ 337 503 | 9,80 |
| Total des Valeurs mobilières | | | | | | \$ 4 176 007 | 121,20 | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|---------------------|--|--|---------------------|
| BPS | 5,220 % | 18/12/2023 | 03/01/2024 | £ 50 000 | Bon du Trésor britannique indexé sur l'inflation 1,125 % échéance 22/11/2037 | \$ (66 329) | \$ 63 740 | \$ 63 854 | 1,85 |
| | 5,240 | 14/12/2023 | 04/01/2024 | 250 000 | Bon du Trésor britannique indexé sur l'inflation 0,125 % - 4,000 % échéance 22/11/2055 - 22/03/2068 | (346 931) | 318 700 | 319 454 | 9,25 |
| BRC | 5,540 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 136 800 | Billets du Trésor américain 2,625 % échéance 31/05/2027 | (139 745) | 136 800 | 136 884 | 3,97 |
| DEU | 5,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 100 | Freddie Mac 7,000 % échéance 01/01/2054 | (104) | 100 | 100 | 0,00 |
| | 5,480 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 100 | Obligations du Trésor américain 2,750 % échéance 15/08/2042 | (103) | 100 | 100 | 0,00 |
| | 5,510 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 159 900 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % échéance 15/02/2053 | (164 281) | 159 900 | 159 924 | 4,64 |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 1 376 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | (1 404) | 1 376 | 1 376 | 0,04 |
| | 5,330 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 53 700 | Obligations du Trésor américain 1,875 % échéance 15/02/2051 | (54 774) | 53 700 | 53 700 | 1,56 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (773 671) | \$ 734 416 | \$ 735 392 | 21,31 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 4 | \$ (18) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 162 | 302 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 922 | (2 008) | (0,06) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 629 | (3 020) | (0,09) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 1 155 | (788) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 2 230 | 4 237 | 0,12 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 1 826 | 3 992 | 0,12 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 6 907 | (23 465) | (0,68) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 2 044 | (2 210) | (0,06) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 536 | (5 229) | (0,15) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 877 | (10 508) | (0,31) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (38 715) | (1,12) |

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AES Corp. | 5,000 % | 20/12/2025 | \$ 500 | \$ (53) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2024 | 5 300 | 32 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 2 700 | (24) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 300 | 5 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 100 | 2 | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/12/2024 | € 7 000 | 41 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | \$ 4 300 | 25 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 400 | 3 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/06/2028 | € 4 300 | 85 | 0,00 |
| | | | | \$ 116 | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-33 Index à 5 ans | (1,000) % | 20/06/2025 | \$ 87 | \$ (6) | 0,00 |
| Indice CDX.HY-40 Index à 5 ans | (5,000) | 20/06/2028 | 7 920 | (451) | (0,01) |
| | | | | \$ (457) | (0,01) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-35 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2025 | \$ 200 | \$ (1) | 0,00 |
| Indice CDX.IG-36 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2026 | 700 | (6) | 0,00 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 3 200 | 22 | 0,00 |
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | € 14 400 | 734 | 0,02 |
| | | | | \$ 749 | 0,02 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 % | 20/03/2029 | £ 37 900 | \$ (2 690) | (0,08) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 19/09/2028 | \$ 62 000 | 1 309 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,725 | 19/09/2028 | 59 800 | 1 273 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 21/12/2052 | 24 100 | 1 882 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,827 | 03/07/2028 | 85 800 | (6 742) | (0,20) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,842 | 19/09/2053 | 12 500 | (567) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,857 | 15/07/2032 | 29 320 | (3 609) | (0,11) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,874 | 19/09/2053 | 11 700 | (575) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,999 | 03/07/2053 | 17 500 | 3 644 | 0,11 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 27/10/2028 | 38 000 | (2 857) | (0,08) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 10/12/2029 | 40 | 5 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,060 | 27/10/2053 | 7 600 | 1 785 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250 | 20/06/2028 | 104 830 | 294 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 3 700 | (54) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 3 700 | (50) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 31 200 | 183 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 3 700 | (50) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,080 | 23/02/2053 | 2 500 | (136) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 3 700 | (43) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 3 700 | (42) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 3 700 | (40) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 9 600 | (124) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 10 800 | (84) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 3 200 | (63) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 7 400 | (13) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 3 200 | (79) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 3 200 | (86) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 6 000 | (169) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 5 800 | (207) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 3 400 | (143) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155 | 02/10/2033 | 22 900 | 1 312 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 17 000 | 997 | 0,03 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,628 | 02/01/2026 | BRL 537 000 | (14) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,231 | 04/01/2027 | 13 900 | (69) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,073 | 04/01/2027 | 136 700 | 149 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,078 | 04/01/2027 | 126 600 | 142 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,115 | 04/01/2027 | 82 400 | 93 | 0,00 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,126 % | 04/01/2027 | BRL 114 100 | \$ 137 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,144 | 04/01/2027 | 271 000 | 2 179 | 0,06 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,219 | 04/01/2027 | 577 900 | (3 704) | (0,11) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,494 | 04/01/2027 | 145 000 | 654 | 0,02 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,821 | 02/01/2025 | 128 000 | (36) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,846 | 04/01/2027 | 76 300 | 460 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,856 | 02/01/2025 | 129 000 | (19) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,900 | 04/01/2027 | 68 000 | 432 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,535 | 04/01/2027 | 185 800 | 1 921 | 0,06 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 01/06/2032 | CAD 20 900 | (332) | (0,01) |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,000 | 21/06/2025 | 387 200 | 532 | 0,02 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | AUD 412 900 | 7 536 | 0,22 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | € 6 700 | (433) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 5 800 | (350) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 3 400 | (215) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 7 200 | (357) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 3 500 | (172) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 8 800 | 41 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 9 000 | 42 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 41 200 | 2 596 | 0,07 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,160 | 16/09/2027 | PLN 93 100 | (1 367) | (0,04) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,210 | 26/04/2027 | 116 600 | (2 519) | (0,07) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,240 | 23/09/2027 | 78 600 | (1 220) | (0,04) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,270 | 20/09/2027 | 89 800 | (1 415) | (0,04) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,280 | 26/09/2027 | 26 700 | (426) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,310 | 19/09/2027 | 94 800 | (1 529) | (0,04) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,985 | 11/10/2027 | 113 000 | (2 563) | (0,07) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 7,156 | 13/10/2027 | 58 300 | (1 416) | (0,04) |
| | | | | | \$ (6 981) | (0,20) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (6 573) | (0,19) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 300 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 2 300 | (11) | (17) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 1 500 | (7) | (19) | 0,00 |
| CBK | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 2 300 | (11) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 1 500 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 5 800 | (24) | (18) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 5 800 | (24) | (17) | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 2 000 | (8) | (6) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 2 000 | (8) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 3 200 | (15) | (23) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 3 700 | (16) | (48) | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 3 200 | (15) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 3 700 | (16) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 2 600 | (10) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 1 800 | (7) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 5 000 | (21) | (17) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 4 300 | (22) | (45) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 4 300 | (21) | (55) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 5 000 | (23) | (81) | (0,01) |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 2 600 | (10) | (9) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 1 800 | (7) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 5 000 | (21) | (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 4 300 | (22) | 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 % | 05/01/2024 | 4 300 | \$ (21) | \$ 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 2 000 | (9) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 2 700 | (11) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 18/01/2024 | 600 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 1 700 | (8) | (27) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 2 000 | (9) | (10) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 2 700 | (11) | (9) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 18/01/2024 | 600 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 1 700 | (8) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 6 000 | (29) | (34) | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 2 600 | (12) | (17) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 1 000 | (5) | (16) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 6 100 | (29) | (110) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 6 000 | (29) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 2 600 | (12) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 1 000 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 6 100 | (29) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 600 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 600 | (3) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (567) | \$ (633) | (0,02) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/12/2024 | \$ 100 | \$ (2) | \$ 3 | \$ 1 | 0,00 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2024 | 400 | (6) | 9 | 3 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2024 | 15 500 | (686) | 742 | 56 | 0,01 |
| HUS | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 300 | (36) | 37 | 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2024 | 300 | (9) | 10 | 1 | 0,00 |
| MYC | Obligations California State General Obligation Bonds, Series 2003 | 1,000 | 20/09/2024 | 2 900 | 23 | (5) | 18 | 0,00 |
| | | | | | \$ (716) | \$ 796 | \$ 80 | 0,01 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17/11/2059 | \$ 800 | \$ (24) | \$ 24 | \$ 0 | 0,00 |
| MYC | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 11 000 | (379) | 378 | (1) | 0,00 |
| UAG | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 10 900 | (378) | 377 | (1) | 0,00 |
| | | | | | \$ (781) | \$ 779 | \$ (2) | 0,00 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 10 041 | AUD 15 157 | \$ 304 | \$ 0 | \$ 304 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH 69 844 | \$ 9 690 | 0 | (175) | (175) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | COP 10 548 516 | 2 758 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 4 705 | 5 976 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 285 073 | 774 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD 1 020 | 621 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 14 241 | 3 365 | 0 | (256) | (256) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 2 623 | COP 10 548 516 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 1 079 | 853 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 146 | HUF 1 452 759 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 01/2024 | 42 843 | ¥ 6 322 296 | 2 030 | 0 | 2 030 | 0,06 |
| | 01/2024 | 199 | MXN 3 391 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 811 | PLN 11 745 | 175 | 0 | 175 | 0,01 |
| | 02/2024 | 824 | CNY 5 825 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 98 304 | \$ 13 573 | 0 | (312) | (312) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR 33 744 797 | 2 146 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 2 718 | COP 10 548 516 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 03/2024 | 342 | IDR 5 344 547 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 03/2024 | 6 548 | INR 547 937 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| BPS | 06/2024 | KRW 1 879 223 | \$ 1 445 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD 1 128 | 746 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL 232 898 | 48 249 | 304 | 0 | 304 | 0,01 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | € 618 007 | \$ 680 282 | \$ 0 | \$ (2 555) | \$ (2 555) | (0,07) |
| | 01/2024 | £ 17 939 | 22 754 | 0 | (115) | (115) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 722 771 | 2 057 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 591 201 | 450 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 815 | AUD 13 198 | 192 | 0 | 192 | 0,01 |
| | 01/2024 | 400 | BRL 1 966 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 390 | CAD 1 890 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 | HUF 1 514 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 150 | IDR 17 787 756 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 6 | KRW 7 894 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 8 209 | ZAR 152 186 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD 528 566 | \$ 16 599 | 0 | (870) | (870) | (0,03) |
| | 02/2024 | \$ 1 463 | CNY 10 388 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 68 032 | \$ 9 453 | 0 | (156) | (156) | (0,01) |
| | 03/2024 | TWD 503 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 105 | CNH 760 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 776 | IDR 42 544 938 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 03/2024 | 22 754 | INR 1 903 238 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 04/2024 | 48 249 | BRL 235 248 | 0 | (218) | (218) | (0,01) |
| | 06/2024 | KRW 8 086 540 | \$ 6 190 | 0 | (105) | (105) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 1 356 915 | 1 050 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 222 164 | 50 809 | 0 | (5 673) | (5 673) | (0,17) |
| | 01/2024 | \$ 3 976 | TRY 118 431 | 2 | (7) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | 993 | ZAR 18 486 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 02/2024 | 5 347 | TRY 163 011 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 03/2024 | 700 | IDR 10 876 829 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 03/2024 | 7 935 | TRY 249 645 | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| | 04/2024 | 11 895 | 383 083 | 0 | (167) | (167) | (0,01) |
| BSH | 06/2024 | KRW 8 327 056 | \$ 6 380 | 0 | (102) | (102) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL 286 000 | 57 383 | 0 | (1 494) | (1 494) | (0,04) |
| | 01/2024 | AUD 877 | 584 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 502 | 636 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 144 811 | 413 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR 15 428 538 | 1 002 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 238 137 | 13 507 | 0 | (492) | (492) | (0,01) |
| | 01/2024 | PLN 9 204 | 2 294 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 984 | AUD 4 438 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 01/2024 | 70 134 | BRL 341 480 | 165 | 0 | 165 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 672 | £ 3 720 | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 537 | MXN 64 972 | 0 | 0 | 283 | 0,01 |
| | 01/2024 | 4 624 | PLN 19 508 | 336 | 0 | 336 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR 222 403 | \$ 11 701 | 0 | (447) | (447) | (0,01) |
| | 03/2024 | PEN 22 378 | 5 943 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 1 002 | IDR 15 432 497 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | 169 | ILS 617 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 04/2024 | BRL 344 938 | \$ 70 134 | 0 | (292) | (292) | (0,01) |
| | 06/2024 | KRW 63 684 | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | £ 250 000 | 313 124 | 0 | (5 577) | (5 577) | (0,16) |
| | 01/2024 | KRW 779 820 | 600 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 551 | PLN 2 149 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 118 | \$ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 46 786 | 6 493 | 0 | (115) | (115) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD 23 590 | 17 821 | 0 | (126) | (126) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 294 | IDR 4 597 112 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| GLM | 06/2024 | KRW 9 002 272 | \$ 6 916 | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD 2 591 | 1 737 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 112 748 | 82 967 | 0 | (2 548) | (2 548) | (0,07) |
| | 01/2024 | £ 50 000 | 63 874 | 134 | 0 | 134 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 147 100 | 1 003 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 15 344 | 885 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 52 295 | BRL 253 700 | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | 01/2024 | 46 412 | MXN 814 004 | 1 440 | 0 | 1 440 | 0,04 |
| | 01/2024 | ZAR 11 398 | \$ 599 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL 242 | 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 43 115 | BRL 220 212 | 2 144 | 0 | 2 144 | 0,06 |
| | 03/2024 | CNH 30 420 | \$ 4 216 | 0 | (81) | (81) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 946 | IDR 14 580 607 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 655 | TRY 51 977 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| JPM | 07/2024 | BRL 266 600 | \$ 53 825 | 0 | (95) | (95) | 0,00 |
| | 01/2024 | 77 391 | 15 617 | 27 | (342) | (315) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 1 491 165 | 4 249 | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 9 574 | 556 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 4 198 | 1 066 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 150 | IDR 17 695 050 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | 451 | KRW 583 270 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 889 | PLN 3 831 | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD 65 952 | \$ 2 059 | 0 | (121) | (121) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 7 713 | BRL 37 828 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| | 02/2024 | 2 831 | TRY 86 403 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 103 073 387 | \$ 6 649 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 988 719 | 31 801 | 0 | (961) | (961) | (0,03) |
| | 03/2024 | \$ 6 823 | INR 570 453 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 04/2024 | \$ 4 293 | BRL 20 930 | \$ 0 | \$ (19) | \$ (19) | 0,00 |
| MBC | 06/2024 | KRW 8 619 753 | \$ 6 651 | 1 | (60) | (59) | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD 1 149 | 761 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 184 | 233 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 974 913 | 2 653 | 0 | (158) | (158) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 4 094 | AUD 6 174 | 120 | 0 | 120 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 669 | £ 1 316 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 733 | \$ 101 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 2 337 | 74 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 1 814 | 2 316 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 104 499 | 297 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 4 532 | 1 131 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 48 | € 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 041 | £ 815 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | 16 290 | ¥ 2 401 622 | 756 | 0 | 756 | 0,02 |
| | 01/2024 | 377 | PLN 1 557 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 919 | ZAR 53 622 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 02/2024 | 859 | CNY 6 082 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 66 650 | \$ 9 242 | 0 | (172) | (172) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 24 182 | IDR 372 343 242 | 7 | (44) | (37) | 0,00 |
| RBC | 06/2024 | KRW 5 253 050 | \$ 4 039 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| RYL | 04/2024 | \$ 66 | MXN 1 167 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | AUD 578 | \$ 389 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 36 919 | 1 946 | 0 | (70) | (70) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 65 434 | 9 038 | 0 | (204) | (204) | (0,01) |
| | 03/2024 | HKD 6 415 | 823 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 16 448 116 | 1 048 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 1 925 | IDR 30 198 460 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 03/2024 | 14 851 | INR 1 241 945 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| SSB | 06/2024 | KRW 4 294 240 | \$ 3 308 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | \$ 4 719 | CLP 4 171 754 | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| | 01/2024 | 26 925 | ¥ 3 949 489 | 1 107 | 0 | 1 107 | 0,03 |
| | 03/2024 | CNH 31 645 | \$ 4 383 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 14 852 726 | 941 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | DKK 1 796 | 264 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 97 497 | 123 385 | 0 | (909) | (909) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 3 311 | AUD 4 991 | 95 | 0 | 95 | 0,00 |
| | 01/2024 | 171 | HUF 62 783 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 01/2024 | 540 | MXN 9 555 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 314 929 | \$ 16 498 | 0 | (700) | (700) | (0,02) |
| | | | | \$ 10 512 | \$ (26 993) | \$ (16 481) | (0,48) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Z en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 5 873 | AUD 8 857 | \$ 172 | \$ 0 | \$ 172 | 0,01 |
| BOA | 01/2024 | 743 | 1 124 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD 438 | \$ 290 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 96 | AUD 141 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | AUD 91 | \$ 60 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 263 | 174 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 93 | AUD 138 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | AUD 33 | \$ 22 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | \$ 1 909 | AUD 2 879 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | AUD 22 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 2 824 | AUD 4 256 | 81 | 0 | 81 | 0,00 |
| | | | | \$ 334 | \$ (17) | \$ 317 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 51 | CAD 69 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 2 587 | 3 517 | 81 | 0 | 81 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | 2 615 | 3 553 | 80 | 0 | 80 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 54 | 73 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 11 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 2 577 | 3 496 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| | | | | \$ 238 | \$ 0 | \$ 238 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | \$ 105 | CHF 90 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 119 | 103 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 197 | 170 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 3 867 | 3 388 | 162 | 0 | 162 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 3 891 | 3 396 | 147 | 0 | 147 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 3 810 | 3 324 | 142 | 0 | 142 | 0,00 |
| | | | | \$ 462 | \$ 0 | \$ 462 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et G Détail en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 2 954 | \$ 3 205 | \$ 1 | \$ (59) | \$ (58) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 4 209 | € 3 847 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 57 689 | 52 455 | 269 | 0 | 269 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | € 1 431 | \$ 1 573 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 839 | 916 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | \$ 58 786 | € 53 484 | 309 | 0 | 309 | 0,01 |
| NGF | 01/2024 | 16 461 | 15 070 | 190 | 0 | 190 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 58 831 | 53 484 | 264 | 0 | 264 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 075 | \$ (78) | \$ 997 | 0,03 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et E en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 66 070 | £ 52 086 | \$ 331 | \$ 0 | \$ 331 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | 210 490 | 166 187 | 1 375 | (4) | 1 371 | 0,04 |
| BRC | 01/2024 | 2 858 | 2 261 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 992 | \$ 1 256 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 054 | £ 2 417 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 2 134 | 1 675 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 219 | \$ 279 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 29 557 | £ 23 338 | 196 | 0 | 196 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 1 345 | 1 061 | 8 | (1) | 7 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | 531 940 | 420 290 | 3 863 | 0 | 3 863 | 0,11 |
| SCX | 01/2024 | 855 958 | 676 711 | 6 742 | 0 | 6 742 | 0,19 |
| SSB | 01/2024 | 20 072 | 15 907 | 207 | 0 | 207 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 837 107 | 661 447 | 6 134 | 0 | 6 134 | 0,18 |
| | | | | \$ 18 909 | \$ (15) | \$ 18 894 | 0,55 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 86 | NOK 918 | \$ 4 | \$ 0 | \$ 4 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 2 | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 96 | 1 027 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | NOK 22 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 | NOK 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 140 | 1 489 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | | | | \$ 16 | \$ 0 | \$ 16 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | SEK 34 | \$ 3 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 751 | SEK 18 262 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | SEK 81 | \$ 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 66 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 80 | SEK 822 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SEK 8 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 29 | SEK 307 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SEK 45 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 0 | SEK 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 1 730 | 17 967 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | SEK 29 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 750 | SEK 18 062 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | | | | \$ 160 | \$ 0 | \$ 160 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 4 048 0,12

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 2,000 % éch. 01/01/2054 | \$ 4 000 | \$ (3 270) | (0,10) |
| 2,000 % éch. 01/02/2054 | 96 900 | (79 307) | (2,30) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (82 577) | (2,40) |
| Total des Investissements | | \$ 5 124 109 | 148,72 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (1 678 536) | (48,72) |
| Actifs nets | | \$ 3 445 573 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

- * Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre vendu avant l'émission.
- (c) Titre à rémunération en nature.
- (d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (e) Titre à coupon zéro.
- (f) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (g) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (h) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (i) Affilié au Fonds.
- (J) Titre convertible conditionnel.
- (k) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,24 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|------------------------|
| Alice France S.A., 11,500 % éch. 01/02/2027 | 20/12/2023 | \$ 2 140 | \$ 2 237 | 0,06 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071 | 10/06/2022 | 0 | 0 | 0,00 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » | 10/06/2022 | 113 | 112 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG 0,898 % éch. 28/05/2024 | 25/05/2021 | 1 900 | 1 866 | 0,05 |
| Deutsche Bank AG 3,035 % éch. 28/05/2032 | 25/05/2021 | 800 | 669 | 0,02 |
| Intelsat Emergence S.A. | 05/09/2018 | 2 000 | 552 | 0,02 |
| Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032 | 29/07/2022 | 2 512 | 2 188 | 0,06 |
| | | \$ 9 465 | \$ 7 624 | 0,21 |

(l) Des titres d'une juste valeur globale de 35 754 \$ (31 décembre 2022 : 2 041 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 69 247 \$ (31 décembre 2022 : 45 907 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 21 652 \$ (31 décembre 2022 : 48 797 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 44 | \$ 4 172 220 | \$ 3 743 | \$ 4 176 007 |
| Fonds d'investissement | 213 446 | 124 057 | 0 | 337 503 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 734 416 | 0 | 734 416 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (5 514) | (35 726) | 0 | (41 240) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (82 577) | 0 | (82 577) |
| Totaux | \$ 207 976 | \$ 4 912 390 | \$ 3 743 | \$ 5 124 109 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 2 707 373 | \$ 4 828 | \$ 2 712 201 |
| Fonds d'investissement | 217 139 | 131 583 | 0 | 348 722 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 145 692 | 0 | 1 145 692 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (2 766) | (83 089) | 0 | (85 855) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (82 152) | 0 | (82 152) |
| Totaux | \$ 214 373 | \$ 3 819 407 | \$ 4 828 | \$ 4 038 608 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 3,200 % | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (482) | \$ (537) | (0,01) |
| JML | (1,000) | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (174) | (192) | (0,01) |
| MBC | 3,100 | 06/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (563) | (625) | (0,02) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (1 354) | (0,04) |

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 301 | \$ (350) | \$ (49) | \$ 36 | \$ 0 | \$ 36 |
| BOA | 2 067 | (2 059) | 8 | (3 100) | 3 170 | 70 |
| BPS | (2 092) | 5 240 | 3 148 | (3 900) | 3 880 | (20) |
| BRC | (5 671) | 5 892 | 221 | (359) | 320 | (39) |
| BSH | (1 494) | 1 850 | 356 | S/O | S/O | S/O |
| CBK | (437) | 270 | (167) | 4 410 | (4 530) | (120) |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (250) | 0 | (250) |
| DUB | (5 911) | 6 570 | 659 | 24 | (100) | (76) |
| FAR | (72) | 0 | (72) | (1 982) | 1 690 | (292) |
| GLM | 726 | (670) | 56 | (17 283) | 17 179 | (104) |
| GST | 60 | 0 | 60 | (48) | 208 | 160 |
| HUS | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (1 504) | 1 540 | 36 | (2 303) | 310 | (1 993) |
| MBC | 184 | 0 | 184 | 2 683 | (3 440) | (757) |
| MYC | (160) | 290 | 130 | (2 059) | 1 970 | (89) |
| MYI | 966 | (1 160) | (194) | 1 202 | (910) | 292 |
| NGF | 190 | 0 | 190 | S/O | S/O | S/O |
| RBC | 2 | 0 | 2 | (86) | 60 | (26) |
| RYL | 3 857 | (4 790) | (933) | (76) | 0 | (76) |
| SAL | S/O | S/O | S/O | (40) | 0 | (40) |
| SCX | 6 522 | (8 040) | (1 518) | (8 642) | 8 280 | (362) |
| SSB | 261 | (290) | (29) | (2 124) | 1 540 | (584) |
| TOR | 998 | (930) | 68 | (12 777) | 9 630 | (3 147) |
| UAG | 5 254 | 0 | 5 254 | (667) | 560 | (107) |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 45,63 | 30,35 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 75,48 | 46,36 |
| Autres valeurs mobilières | 0,09 | 1,16 |
| Fonds d'investissement | 9,80 | 10,00 |
| Contrats de mise en pension | 21,31 | 32,89 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (1,12) | 0,08 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,19) | (1,19) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,12 | (1,36) |
| Titres vendus à découvert | (2,40) | (2,36) |
| Contrats de prise en pension | (0,04) | (0,06) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 1,05 | 1,91 |
| Obligations et billets privés | 21,59 | 22,11 |
| Obligations et billets convertibles | 0,22 | 0,40 |
| Obligations et billets municipaux | 0,26 | 0,35 |
| Agences du gouvernement américain | 52,17 | 8,36 |
| Obligations du Trésor américain | 8,61 | 2,61 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 7,47 | 8,21 |
| Titres adossés à des actifs | 16,91 | 18,00 |
| Émissions souveraines | 5,72 | 3,20 |
| Actions ordinaires | 0,08 | 0,05 |
| Droits | S/O | 0,00 |
| Bons de souscription | 0,00 | 0,00 |
| Titres privilégiés | 0,03 | 0,17 |
| Instruments à court terme | 7,09 | 12,50 |
| Fonds d'investissement | 9,80 | 10,00 |
| Contrats de mise en pension | 21,31 | 32,89 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (1,12) | 0,08 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | 0,00 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,03) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,01) | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,02 | 0,03 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,20) | (1,19) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,34 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (0,95) |
| Options sur titres | S/O | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | S/O | 0,02 |
| Contrats de change à terme | (0,48) | (1,05) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,61 | 0,29 |
| Titres vendus à découvert | (2,40) | (2,36) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (48,72) | (15,93) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------|------|--|
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | | | | | | | | | | | |
| Accredited Mortgage Loan Trust | | | | 4,695 % éch. 15/07/2031 | € | 2 684 | 0,08 | 4,695 % éch. 15/07/2031 | € | 2 684 | 0,08 | | | |
| 6,340 % éch. 25/09/2035 | 2 800 | 2 369 | 0,07 | CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | | 4,745 % éch. 15/04/2031 | 1 469 | 1 449 | 0,04 | | | |
| Accunia European CLO DAC | | | | 4,555 % éch. 15/09/2031 | € | 2 689 | 0,08 | Palmerston Park CLO DAC | | | | | | |
| 4,895 % éch. 15/10/2030 | € | 445 | 0,01 | 4,615 % éch. 15/10/2031 | 8 681 | 8 565 | 0,26 | 4,625 % éch. 18/04/2030 | 598 | 595 | 0,02 | | | |
| 4,915 % éch. 15/07/2030 | 852 | 851 | 0,03 | 4,652 % éch. 21/07/2030 | 4 440 | 4 390 | 0,13 | PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartiment | | | | | | |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | Dryden Euro CLO DAC | | | | 4,576 % éch. 26/11/2030 | 5 888 | 5 899 | 0,18 | | | |
| 5,770 % éch. 25/04/2036 | \$ | 199 | 0,01 | 4,625 % éch. 15/04/2033 | 4 974 | 4 902 | 0,15 | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | | | |
| 5,770 % éch. 25/07/2036 | 232 | 69 | 0,00 | 4,862 % éch. 15/05/2034 | 5 889 | 5 800 | 0,18 | 5,285 % éch. 25/01/2037 | \$ | 227 | 69 | 0,00 | | |
| Adagio CLO DAC | | | | Ellington Loan Acquisition Trust | | | | 5,545 % éch. 25/01/2037 | 334 | 106 | 0,00 | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | € | 2 500 | 0,08 | 6,570 % éch. 25/05/2037 | \$ | 85 | 0,00 | Residential Asset Securities Corp. Trust | | | | | | |
| Aqueduct European CLO DAC | | | | Euro-Galaxy CLO DAC | | | | 6,150 % éch. 25/05/2037 | 1 033 | 916 | 0,03 | | | |
| 4,633 % éch. 20/07/2030 | 2 477 | 2 459 | 0,08 | 4,589 % éch. 24/04/2034 | € | 3 696 | 0,11 | Saxon Asset Securities Trust | | | | | | |
| Ares European CLO DAC | | | | First Franklin Mortgage Loan Trust | | | | 5,905 % éch. 25/09/2036 | 7 500 | 6 384 | 0,20 | | | |
| 4,625 % éch. 15/10/2030 | 2 848 | 2 828 | 0,09 | 6,175 % éch. 25/11/2036 | \$ | 6 491 | 0,17 | Segovia European CLO DAC | | | | | | |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | 6 317 | 6 257 | 0,19 | Fremont Home Loan Trust | | | | 4,873 % éch. 20/07/2032 | € | 4 100 | 4 048 | 0,12 | | |
| Armada Euro CLO DAC | | | | 5,610 % éch. 25/01/2037 | 381 | 170 | 0,01 | Silver Arrow Merfina SRL | | | | | | |
| 4,685 % éch. 15/07/2031 | 6 266 | 6 200 | 0,19 | FTA Santander Consumo | | | | 4,559 % éch. 20/07/2033 | 6 321 | 6 331 | 0,19 | | | |
| Aurium CLO DAC | | | | 4,773 % éch. 21/03/2036 | € | 1 986 | 0,06 | Silver Arrow S.A. | | | | | | |
| 4,635 % éch. 16/04/2030 | 594 | 588 | 0,02 | GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC | | | | 4,533 % éch. 15/09/2027 | 88 | 88 | 0,00 | | | |
| Avoca CLO DAC | | | | 4,893 % éch. 20/01/2032 | 900 | 891 | 0,03 | Soundview Home Loan Trust | | | | | | |
| 4,655 % éch. 15/07/2030 | 978 | 973 | 0,03 | Griffith Park CLO DAC | | | | 5,620 % éch. 25/03/2037 | \$ | 52 | 44 | 0,00 | | |
| 4,785 % éch. 15/10/2032 | 1 900 | 1 877 | 0,06 | 4,704 % éch. 21/11/2031 | 16 032 | 15 779 | 0,48 | 5,640 % éch. 25/07/2037 | 716 | 554 | 0,02 | | | |
| Bain Capital Euro CLO DAC | | | | GSAA Home Equity Trust | | | | 5,640 % éch. 25/08/2037 | 818 | 626 | 0,02 | | | |
| 4,733 % éch. 20/01/2032 | 2 853 | 2 818 | 0,09 | 5,570 % éch. 25/12/2046 | \$ | 925 | 0,01 | 5,970 % éch. 25/10/2036 | 146 | 124 | 0,00 | | | |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | | 5,985 % éch. 25/06/2036 | 1 129 | 271 | 0,01 | 6,370 % éch. 25/10/2037 | 1 847 | 1 313 | 0,04 | | | |
| 6,520 % éch. 25/08/2037 | \$ | 157 | 0,00 | Harvest CLO DAC | | | | Tikehau CLO DAC | | | | | | |
| Black Diamond CLO DAC | | | | 1,040 % éch. 15/07/2031 | € | 500 | 0,01 | 4,844 % éch. 04/08/2034 | € | 2 300 | 2 273 | 0,07 | | |
| 4,853 % éch. 20/01/2032 | € | 1 209 | 0,04 | 4,566 % éch. 26/06/2030 | 2 646 | 2 618 | 0,08 | Toro European CLO DAC | | | | | | |
| 4,982 % éch. 15/05/2032 | 2 931 | 2 894 | 0,09 | 4,605 % éch. 15/10/2031 | 4 299 | 4 227 | 0,13 | 4,812 % éch. 15/02/2034 | 5 300 | 5 228 | 0,16 | | | |
| Blackrock European CLO DAC | | | | 4,673 % éch. 20/10/2031 | 7 281 | 7 174 | 0,22 | 4,908 % éch. 12/01/2032 | 1 700 | 1 687 | 0,05 | | | |
| 4,585 % éch. 15/10/2031 | 4 910 | 4 833 | 0,15 | 4,725 % éch. 15/07/2031 | 4 000 | 3 943 | 0,12 | | | | 295 891 | 9,07 | | |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | | 4,815 % éch. 15/01/2032 | 19 900 | 19 647 | 0,60 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| 1,050 % éch. 15/01/2031 | 397 | 376 | 0,01 | Hill FL BV | | | | Agence Française de Développement | | | | | | |
| 4,615 % éch. 15/07/2030 | 1 036 | 1 032 | 0,03 | 4,544 % éch. 18/05/2030 | 8 745 | 8 772 | 0,27 | 0,375 % éch. 30/04/2024 | 2 100 | 2 076 | 0,06 | | | |
| 4,685 % éch. 15/01/2031 | 3 079 | 3 045 | 0,09 | Invesco Euro CLO DAC | | | | Bpifrance Financement S.A. | | | | | | |
| 4,875 % éch. 15/01/2033 | 1 000 | 985 | 0,03 | 4,615 % éch. 15/07/2031 | 500 | 492 | 0,02 | 4,000 % éch. 30/01/2026 | € | 2 400 | 2 743 | 0,08 | | |
| BNPP AM Euro CLO DAC | | | | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | | Caisse des dépôts et consignations | | | | | | |
| 4,565 % éch. 15/04/2031 | 300 | 295 | 0,01 | 5,680 % éch. 25/10/2036 | \$ | 67 | 0,00 | 3,375 % éch. 25/11/2030 | € | 4 500 | 4 724 | 0,14 | | |
| 4,615 % éch. 15/10/2031 | 246 | 243 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/03/2037 | 12 800 | 10 653 | 0,33 | Caisse Française de Financement Local | | | | | | |
| Cairn CLO DAC | | | | Jubilee CLO DAC | | | | 3,625 % éch. 17/01/2029 | 700 | 729 | 0,02 | | | |
| 4,552 % éch. 30/04/2031 | 3 501 | 3 460 | 0,11 | 4,565 % éch. 15/04/2030 | € | 1 284 | 0,04 | Development Bank of Japan, Inc. | | | | | | |
| 4,618 % éch. 31/01/2030 | 591 | 586 | 0,02 | 4,575 % éch. 15/04/2030 | 3 589 | 3 568 | 0,11 | 4,500 % éch. 06/06/2025 | € | 1 100 | 1 262 | 0,04 | | |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | 3 698 | 3 637 | 0,11 | 4,615 % éch. 15/04/2031 | 4 300 | 4 230 | 0,13 | Exportation et Développement Canada | | | | | | |
| Carlyle Euro CLO DAC | | | | Koromo Italy SRL | | | | 4,000 % éch. 19/02/2026 | 12 500 | 14 345 | 0,44 | | | |
| 4,632 % éch. 15/08/2030 | 160 | 159 | 0,01 | 4,676 % éch. 26/02/2035 | 2 100 | 2 106 | 0,06 | Obligation internationale du gouvernement français | | | | | | |
| 4,665 % éch. 15/01/2031 | 4 958 | 4 910 | 0,15 | Laurelin DAC | | | | 0,000 % éch. 25/03/2024 (b) | € | 10 150 | 10 068 | 0,31 | | |
| 4,892 % éch. 15/08/2032 | 1 450 | 1 431 | 0,04 | 4,713 % éch. 20/10/2031 | 4 465 | 4 421 | 0,14 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | | | | |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC | | | | Madison Park Euro Funding DAC | | | | 0,000 % éch. 15/01/2024 (b) | 19 800 | 19 777 | 0,61 | | | |
| 4,925 % éch. 16/01/2033 | 1 000 | 985 | 0,03 | 4,765 % éch. 15/07/2032 | 3 200 | 3 157 | 0,10 | 4,500 % éch. 01/03/2024 | 30 000 | 30 032 | 0,92 | | | |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | | Man GLG Euro CLO DAC | | | | Obligation internationale du gouvernement roumain | | | | | | |
| 4,752 % éch. 15/11/2031 | 3 643 | 3 593 | 0,11 | 4,615 % éch. 15/12/2031 | 4 063 | 4 016 | 0,12 | 5,000 % éch. 27/09/2026 | 26 000 | 26 729 | 0,82 | | | |
| Carrington Mortgage Loan Trust | | | | 4,645 % éch. 15/10/2030 | 1 175 | 1 167 | 0,04 | Obligation internationale du gouvernement serbe | | | | | | |
| 6,070 % éch. 25/01/2036 | \$ | 8 850 | 0,24 | 4,835 % éch. 15/01/2030 | 262 | 262 | 0,01 | 6,250 % éch. 26/05/2028 | \$ | 300 | 279 | 0,01 | | |
| CIT Mortgage Loan Trust | | | | Marlay Park CLO DAC | | | | SNCF Réseau | | | | | | |
| 6,970 % éch. 25/10/2037 | 397 | 356 | 0,01 | 4,705 % éch. 15/10/2030 | 815 | 809 | 0,03 | 4,500 % éch. 30/01/2024 | € | 119 300 | 119 333 | 3,66 | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | | Stockholms Lans Landsting | | | | | | |
| 4,215 % éch. 25/10/2037 | 738 | 572 | 0,02 | 6,250 % éch. 25/02/2034 | \$ | 1 139 | 0,03 | 0,750 % éch. 26/02/2025 | 7 000 | 6 802 | 0,21 | | | |
| 7,250 % éch. 25/05/2036 | 104 | 49 | 0,00 | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | Ville de Paris | | | | | | |
| Contego CLO BV | | | | 5,720 % éch. 25/07/2036 | 127 | 101 | 0,00 | 0,010 % éch. 02/01/2024 | 16 550 | 16 543 | 0,51 | | | |
| 4,735 % éch. 15/10/2030 | € | 998 | 0,03 | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 256 | 87 | 0,00 | | | | 255 442 | 7,83 | | |
| Contego CLO DAC | | | | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | | ACTIONS | | | | | | |
| 4,642 % éch. 23/01/2030 | 2 292 | 2 260 | 0,07 | 5,570 % éch. 25/04/2037 | 98 | 46 | 0,00 | SERVICES DE COMMUNICATION | | | | | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | Alphabet, Inc. « A » (a) | 96 100 | 12 152 | 0,37 | | | |
| 5,610 % éch. 25/08/2037 | \$ | 536 | 0,01 | 5,670 % éch. 25/09/2037 | 117 | 102 | 0,00 | BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE | | | | | | |
| 5,690 % éch. 25/09/2037 | 49 | 45 | 0,00 | Oak Hill European Credit Partners DAC | | | | Airbnb, Inc. « A » (a) | 41 060 | 5 060 | 0,15 | | | |
| 5,720 % éch. 25/02/2036 | 101 | 86 | 0,00 | 4,723 % éch. 20/01/2032 | € | 820 | 0,03 | Best Buy Co., Inc. | 58 300 | 4 131 | 0,13 | | | |
| | | | | 4,733 % éch. 20/10/2031 | 8 179 | 8 089 | 0,25 | Booking Holdings, Inc. (a) | 1 738 | 5 581 | 0,17 | | | |
| | | | | OCP Euro CLO DAC | | | | Luminar Technologies, Inc. (a) | 679 800 | 2 074 | 0,06 | | | |
| | | | | 4,882 % éch. 22/09/2034 | 5 200 | 5 126 | 0,16 | QuantumScape Corp. (a) | 78 600 | 495 | 0,02 | | | |
| | | | | 5,873 % éch. 20/01/2033 | 20 900 | 20 901 | 0,64 | | | | | 17 341 | 0,53 | |
| | | | | Option One Mortgage Loan Trust | | | | | | | | | | |
| | | | | 5,610 % éch. 25/03/2037 | \$ | 160 | 0,00 | | | | | | | |
| | | | | 5,690 % éch. 25/04/2037 | 472 | 292 | 0,01 | | | | | | | |
| | | | | 5,690 % éch. 25/05/2037 | 343 | 184 | 0,01 | | | | | | | |
| | | | | 6,250 % éch. 25/11/2034 | 106 | 92 | 0,00 | | | | | | | |
| | | | | Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | | | | | | | |
| | | | | 4,685 % éch. 15/10/2031 | € | 3 650 | 0,11 | | | | | | | |

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-----------|----------------------------|---------------------|
| ÉNERGIE | | | |
| Exxon Mobil Corp. | 110 100 | € 9 965 | 0,31 |
| Neste Oyj | 394 100 | 12 691 | 0,39 |
| | | 22 656 | 0,70 |
| SOINS DE SANTÉ | | | |
| Centene Corp. (a) | 183 600 | 12 334 | 0,38 |
| Elevance Health, Inc. | 25 970 | 11 086 | 0,34 |
| Humana, Inc. | 12 135 | 5 029 | 0,15 |
| Incyte Corp. (a) | 91 900 | 5 224 | 0,16 |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (a) | 15 070 | 11 982 | 0,37 |
| Vertex Pharmaceuticals, Inc. (a) | 34 360 | 12 657 | 0,39 |
| | | 58 312 | 1,79 |
| INDUSTRIE | | | |
| ABB Ltd. | 363 540 | 14 601 | 0,45 |
| Aker Carbon Capture ASA (a) | 6 124 174 | 7 397 | 0,23 |
| Ballard Power Systems, Inc. (a) | 489 000 | 1 648 | 0,05 |
| Fastenal Co. | 104 400 | 6 121 | 0,19 |
| FuelCell Energy, Inc. (a) | 1 446 800 | 2 096 | 0,06 |
| Hitachi Zosen Corp. | 2 829 100 | 16 975 | 0,52 |
| Industrie De Nora SpA | 99 276 | 1 561 | 0,05 |
| ITM Power PLC (a) | 2 154 624 | 1 480 | 0,04 |
| NEL ASA (a) | 7 840 925 | 4 796 | 0,15 |
| Paychex, Inc. | 50 900 | 5 488 | 0,17 |
| PowerCell Sweden AB (a) | 198 703 | 826 | 0,02 |
| Rexel S.A. | 428 900 | 10 663 | 0,33 |
| Rockwell Automation, Inc. | 14 740 | 4 143 | 0,13 |
| Schneider Electric SE | 69 500 | 12 673 | 0,39 |
| Sensata Technologies Holding PLC | 199 676 | 6 791 | 0,21 |
| Siemens AG (a) | 60 700 | 10 316 | 0,31 |
| Valmet Oyj | 318 300 | 8 338 | 0,25 |
| Vestas Wind Systems A/S | 714 100 | 20 468 | 0,63 |
| | | 136 381 | 4,18 |
| TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION | | | |
| Applied Materials, Inc. | 79 700 | 11 693 | 0,36 |
| Arista Networks, Inc. (a) | 40 300 | 8 592 | 0,26 |
| Canadian Solar, Inc. (a) | 157 400 | 3 737 | 0,11 |
| Chipbond Technology Corp. | 581 908 | 1 240 | 0,04 |
| Cisco Systems, Inc. | 220 500 | 10 084 | 0,31 |
| Delta Electronics, Inc. | 728 112 | 6 722 | 0,21 |
| Elan Microelectronics Corp. | 529 109 | 2 533 | 0,08 |
| Enphase Energy, Inc. (a) | 147 500 | 17 644 | 0,54 |
| EPAM Systems, Inc. (a) | 48 250 | 12 988 | 0,40 |
| First Solar, Inc. (a) | 97 000 | 15 128 | 0,46 |
| Flex Ltd. (a) | 360 300 | 9 935 | 0,30 |
| Globalwafers Co. Ltd. | 185 309 | 3 201 | 0,10 |
| Keysight Technologies, Inc. (a) | 77 700 | 11 190 | 0,34 |
| KLA Corp. | 23 720 | 12 482 | 0,38 |
| Lam Research Corp. | 17 450 | 12 373 | 0,38 |
| MediaTek, Inc. | 96 008 | 2 870 | 0,09 |
| Nanya Technology Corp. | 881 907 | 2 026 | 0,06 |
| NetApp, Inc. | 132 800 | 10 599 | 0,33 |
| Novatek Microelectronics Corp. | 175 204 | 2 668 | 0,08 |
| QUALCOMM, Inc. | 95 200 | 12 464 | 0,38 |
| Realtek Semiconductor Corp. | 205 407 | 2 851 | 0,09 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 211 200 | 11 605 | 0,36 |
| SMA Solar Technology AG (a) | 99 102 | 6 014 | 0,18 |
| SolarEdge Technologies, Inc. (a) | 97 300 | 8 245 | 0,25 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-----------|-------------------------------|---------------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | | | |
| | 544 809 | € 9 455 | 0,29 |
| Teradyne, Inc. | | | |
| | 111 200 | 10 924 | 0,34 |
| Trimble, Inc. (a) | | | |
| | 144 100 | 6 940 | 0,21 |
| Unimicron Technology Corp. | | | |
| | 513 100 | 2 654 | 0,08 |
| United Microelectronics Corp. | | | |
| | 3 749 819 | 5 784 | 0,18 |
| | | 234 641 | 7,19 |
| MATÉRIAUX | | | |
| Calix Ltd. (a) | 1 188 128 | 2 514 | 0,08 |
| Canfor Corp. (a) | 504 023 | 6 177 | 0,19 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 149 600 | 10 766 | 0,33 |
| DS Smith PLC | 1 808 600 | 6 407 | 0,20 |
| Hanwha Solutions Corp. (a) | 190 574 | 5 244 | 0,16 |
| Holmen AB « B » | 377 300 | 14 438 | 0,44 |
| LG Chem Ltd. | 14 750 | 5 136 | 0,16 |
| Nucor Corp. | 69 600 | 10 966 | 0,33 |
| Steel Dynamics, Inc. | 113 500 | 12 134 | 0,37 |
| Stora Enso Oyj « R » | 739 500 | 9 281 | 0,28 |
| thyssenkrupp AG | 768 400 | 4 842 | 0,15 |
| Umicore S.A. | 156 400 | 3 897 | 0,12 |
| UPM-Kymmene Oyj | 426 900 | 14 587 | 0,45 |
| West Fraser Timber Co. Ltd. | 78 800 | 6 133 | 0,19 |
| | | 112 522 | 3,45 |
| | | 594 005 | 18,21 |
| TITRES PRIVILÉGIÉS | | | |
| Hanwha Solutions Corp. 0,000 % | 4 662 | 85 | 0,00 |
| SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER | | | |
| Weyerhaeuser Co. | 182 500 | 5 744 | 0,18 |
| | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| BILLETTS DE TRÉSORERIE | | | |
| Bpifrance | | | |
| 3,974 % éch. 11/03/2024 | € 10 000 | 9 921 | 0,30 |
| Fidelity National Information Services, Inc. | | | |
| 4,086 % éch. 10/01/2024 | 12 500 | 12 483 | 0,38 |
| Fiserv, Inc | | | |
| 4,076 % éch. 22/02/2024 | 15 000 | 14 909 | 0,46 |
| Oesterreichische Kontrollbank AG | | | |
| 3,990 % éch. 22/01/2024 | 65 000 | 64 831 | 1,99 |
| 3,995 % éch. 02/04/2024 | 16 250 | 16 084 | 0,49 |
| SGS Nederland Holding BV | | | |
| 4,339 % éch. 22/01/2024 | 13 300 | 13 265 | 0,41 |
| | | 131 493 | 4,03 |
| BONS DU TRÉSOR AUTRICHIEN | | | |
| 3,892 % éch. | | | |
| 25/01/2024 (b)(c) | 700 | 699 | 0,02 |
| 3,935 % éch. | | | |
| 25/04/2024 (b)(c) | 1 300 | 1 285 | 0,04 |
| | | 1 984 | 0,06 |
| BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILITÉ | | | |
| 3,855 % éch. | | | |
| 23/05/2024 (b)(c) | 10 000 | 9 858 | 0,30 |
| BONS DU TRÉSOR DE L'UNION EUROPÉENNE | | | |
| 3,707 % éch. | | | |
| 12/01/2024 (b)(c) | 730 | 730 | 0,03 |
| 3,717 % éch. | | | |
| 12/01/2024 (b)(c) | 730 | 729 | 0,02 |
| | | 1 459 | 0,05 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS | | | |
| 3,827 % éch. | | | |
| 02/05/2024 (b)(c) | € 25 000 | € 24 702 | 0,76 |
| 3,842 % éch. | | | |
| 28/02/2024 (b)(c) | 18 970 | 18 863 | 0,58 |
| | | 43 565 | 1,34 |
| BONS DU TRÉSOR ALLEMAND | | | |
| 3,630 % éch. | | | |
| 20/03/2024 (b)(c) | 6 030 | 5 984 | 0,18 |
| BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | |
| (0,257) % éch. | | | |
| 04/04/2024 (b)(c) | ¥ 14 150 000 | 90 908 | 2,79 |
| (0,238) % éch. | | | |
| 15/01/2024 (b)(c) | 6 442 000 | 41 367 | 1,27 |
| (0,226) % éch. | | | |
| 15/01/2024 (b)(c) | 2 778 000 | 17 839 | 0,55 |
| (0,174) % éch. | | | |
| 18/03/2024 (b)(c) | 2 042 000 | 13 117 | 0,40 |
| (0,156) % éch. | | | |
| 18/03/2024 (b)(c) | 328 000 | 2 107 | 0,06 |
| | | 165 338 | 5,07 |
| BONS DU TRÉSOR SUISSE | | | |
| 1,636 % éch. | | | |
| 22/02/2024 (b)(c) | CHF 8 800 | 9 445 | 0,29 |
| 1,697 % éch. | | | |
| 14/03/2024 (b)(c) | 30 000 | 32 168 | 0,99 |
| | | 41 613 | 1,28 |
| BONS DU TRÉSOR BRITANNIQUE | | | |
| 5,265 % éch. | | | |
| 05/02/2024 (b)(c) | £ 25 000 | 28 712 | 0,88 |
| 5,270 % éch. | | | |
| 18/03/2024 (b)(c) | 20 000 | 22 831 | 0,70 |
| 5,280 % éch. | | | |
| 11/03/2024 (b)(c) | 26 100 | 29 825 | 0,91 |
| 5,289 % éch. | | | |
| 11/03/2024 (b)(c) | 26 100 | 29 825 | 0,91 |
| 5,299 % éch. | | | |
| 11/03/2024 (b)(c) | 27 850 | 31 824 | 0,98 |
| | | 143 017 | 4,38 |
| Total des Instruments à court terme | | 544 311 | 16,69 |
| Total des Valeurs mobilières | €3 381 141 | 103,66 | |
| ACTIONS | | | |
| FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Capital Securities Fund (f) | | | |
| | 2 064 482 | 21 025 | 0,65 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Income Fund (f) | | | |
| | 6 473 317 | 106 770 | 3,26 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (f) | | | |
| | 3 189 591 | 31 589 | 0,97 |
| | | 159 384 | 4,88 |
| FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | 1 536 500 | 149 880 | 4,60 |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (f) | | | |
| | 310 100 | 3 401 | 0,10 |
| | | 153 281 | 4,70 |
| Total des Fonds d'investissement | € 312 665 | 9,58 | |

Tableau des investissements Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net | |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|-------|
| BPS | 3,500 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | € 256 700 | Obligation internationale du gouvernement belge 3,300 % échéance 22/06/2054 | € (253 574) | € 256 700 | € 256 800 | 7,86 | |
| CEW | 3,700 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 70 000 | Union européenne 2,000 % échéance 04/10/2027 | (72 014) | 70 000 | 70 029 | 2,15 | |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 35 513 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | (32 792) | 32 149 | 32 156 | 0,99 | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | € (358 380) | € 358 849 | € 358 985 | 11,00 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 7 529 | € 15 471 | 0,47 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 614 | 6 000 | 0,18 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini Russell 2000 Index mars | Long | 03/2024 | 1 120 | 5 161 | 0,16 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars | Long | 03/2024 | 2 422 | 17 720 | 0,54 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Euro STOXX 50 Index mars | Long | 03/2024 | 728 | (215) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 900 | 4 055 | 0,12 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 2 467 | 10 715 | 0,33 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 1 916 | 3 142 | 0,10 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 696 | 5 849 | 0,18 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 1 707 | (7 989) | (0,24) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 606 | 4 795 | 0,15 |
| | | | | € 64 704 | 1,98 |

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|-----------------|-------------------|------------------|------|--------------|---------------------|
| Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation EUREX Euro-Bund mars 2024 | € 118,000 | 23/02/2024 | 200 | € 2 | € 2 | 0,00 |

OPTIONS SUR INDICES

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|-----------------|-------------------|------------------|---------|--------------|---------------------|
| Option de vente - Indice CBOE S&P 500 Index | € 4 250,000 | 19/01/2024 | 361 | € 3 832 | € 47 | 0,00 |
| Option de vente - Indice CBOE S&P 500 Index | 4 400,000 | 15/03/2024 | 231 | 1 270 | 478 | 0,02 |
| Option de vente - Indice EUREX EURO STOXX 50 Index | 3 900,000 | 19/01/2024 | 1 636 | 1 281 | 19 | 0,00 |
| Option de vente - Indice EUREX EURO STOXX 50 Index | 4 050,000 | 19/01/2024 | 1 695 | 1 336 | 31 | 0,00 |
| | | | | € 7 719 | € 575 | 0,02 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR INDICES

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|-----------------|-------------------|------------------|-----------|--------------|---------------------|
| Option de vente - Indice CBOE S&P 500 Index | € 4 000,000 | 19/01/2024 | 361 | € (2 002) | € (28) | 0,00 |
| Option d'achat - Indice CBOE S&P 500 Index | 4 650,000 | 19/01/2024 | 361 | (1 021) | (4 743) | (0,14) |
| Option de vente - Indice CBOE S&P 500 Index | 4 200,000 | 15/03/2024 | 231 | (698) | (260) | (0,01) |
| Option d'achat - Indice CBOE S&P 500 Index | 4 900,000 | 15/03/2024 | 231 | (454) | (1 236) | (0,04) |
| Option de vente - Indice EUREX EURO STOXX 50 Index | 3 700,000 | 19/01/2024 | 1 636 | (707) | (10) | 0,00 |
| Option de vente - Indice EUREX EURO STOXX 50 Index | 3 850,000 | 19/01/2024 | 1 695 | (709) | (17) | 0,00 |
| Option d'achat - Indice EUREX EURO STOXX 50 Index | 4 300,000 | 19/01/2024 | 1 636 | (661) | (3 821) | (0,12) |
| Option d'achat - Indice EUREX EURO STOXX 50 Index | 4 450,000 | 19/01/2024 | 1 695 | (656) | (1 694) | (0,05) |
| | | | | € (6 908) | € (11 809) | (0,36) |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

€ 53 472 1,64

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 500 | € (3) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2027 | 100 | 2 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 1 000 | 13 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 200 | 2 | 0,00 |
| | | | | € 14 | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2028 | \$ 1 069 500 | € 6 577 | 0,20 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 % | 20/03/2029 | £ 235 600 | € 15 294 | 0,47 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | \$ 110 400 | 2 612 | 0,08 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2030 | 324 500 | 2 612 | 0,08 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 30 500 | 674 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 174 400 | (449) | (0,02) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,250 | 16/06/2031 | CAD 82 272 | (4 287) | (0,13) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,900 | 18/12/2029 | £ 181 | (17) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | £ 17 200 | 604 | 0,02 |
| | | | | | € 17 043 | 0,52 |
| | | | | | € 23 634 | 0,72 |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽³⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/ à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/ (reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------|-----------------------------------|----------------------------|---|-------------------|-----------------|-------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir | Indice IXUTR Index | 27 667 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 88 529 | 02/10/2024 | € 0 | € (347) | € (347) | (0,01) |
| BPS | À payer | Indice EURO STOXX Bar Index | 448 000 | 3,909 % | € 53 034 | 23/10/2024 | 0 | 273 | 273 | 0,01 |
| | À recevoir | Indice EURO STOXX Insurance Index | 148 400 | 4,009 | 51 918 | 23/10/2024 | 0 | (284) | (284) | (0,01) |
| JPM | À payer | Indice SPSIHOTR Index | 700 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 8 620 | 20/03/2024 | 0 | 30 | 30 | 0,00 |
| RBC | À payer | Indice SPSIHOTR Index | 1 544 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 19 014 | 01/05/2024 | 0 | 67 | 67 | 0,00 |
| | | | | | | | € 0 | € (261) | € (261) | (0,01) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | € 1 556 | AUD 2 522 | € 2 | € 0 | € 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 5 286 | € 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | COP 83 766 468 | \$ 21 900 | 274 | 0 | 274 | 0,01 |
| | 01/2024 | € 5 060 | AUD 8 346 | 95 | 0 | 95 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 605 | CAD 2 366 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 178 | £ 1 877 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 41 835 | \$ 113 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 01/2024 | ¥ | 9 220 000 | € | 59 477 | € | 197 | 0,01 |
| | 01/2024 | \$ | 20 826 | COP | 83 766 468 | € | 698 | 0,02 |
| | 02/2024 | | 66 | CNY | 469 | | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 88 | CNH | 636 | | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 21 584 | COP | 83 766 468 | | 0 | (0,01) |
| | 03/2024 | | 13 958 | INR | 1 167 988 | | 26 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD | 49 533 | € | 29 838 | | 0 | (0,02) |
| | 01/2024 | € | 3 766 | AUD | 6 123 | | 17 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 5 165 | £ | 4 469 | | 6 | (0,00) |
| | 01/2024 | | 1 047 | ¥ | 168 100 | | 32 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 56 835 | \$ | 62 145 | | 2 | (0,02) |
| | 01/2024 | £ | 26 534 | € | 30 864 | | 249 | 0,01 |
| | 01/2024 | \$ | 111 258 | | 101 490 | | 795 | 0,02 |
| | 01/2024 | | 26 248 | ZAR | 486 601 | | 294 | 0,01 |
| | 02/2024 | TWD | 494 528 | \$ | 15 558 | | 0 | (0,02) |
| | 02/2024 | \$ | 118 | CNY | 836 | | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 3 796 556 | \$ | 120 530 | | 0 | (0,15) |
| | 03/2024 | \$ | 48 503 | INR | 4 056 958 | | 73 | 0,00 |
| BRC | 06/2024 | KRW | 4 881 735 | \$ | 3 737 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | € | 14 477 | AUD | 23 681 | | 150 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 643 | CAD | 3 873 | | 15 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 601 | £ | 2 256 | | 3 | (0,00) |
| | 01/2024 | | 114 693 | \$ | 123 964 | | 0 | (0,08) |
| | 01/2024 | NOK | 3 090 | € | 263 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | \$ | 67 071 | MXN | 1 176 720 | | 1 906 | 0,06 |
| | 01/2024 | | 1 279 | PLN | 5 594 | | 129 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 396 | TRY | 12 048 | | 6 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 1 397 | | 42 630 | | 0 | (0,00) |
| | 03/2024 | | 7 012 | | 220 261 | | 0 | (0,00) |
| | 04/2024 | | 7 756 | | 249 935 | | 0 | (0,00) |
| CBK | 06/2024 | KRW | 5 031 803 | \$ | 3 855 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | DKK | 96 571 | € | 12 958 | | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 2 124 639 | \$ | 121 190 | | 0 | (0,10) |
| | 03/2024 | ILS | 436 268 | | 119 827 | | 0 | (0,04) |
| | 03/2024 | TWD | 172 157 | | 5 448 | | 0 | (0,01) |
| DUB | 03/2024 | \$ | 80 416 | PEN | 302 813 | | 1 061 | 0,03 |
| | 01/2024 | € | 49 167 | NOK | 564 530 | | 1 151 | 0,03 |
| | 03/2024 | SGD | 20 | \$ | 15 | | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | ¥ | 14 150 000 | € | 91 229 | | 0 | (0,02) |
| GLM | 06/2024 | KRW | 5 439 816 | \$ | 4 179 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | CHF | 20 990 | € | 21 821 | | 0 | (0,02) |
| | 01/2024 | DKK | 19 056 | | 2 557 | | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 2 859 | \$ | 3 087 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | HUF | 7 802 845 | | 22 332 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | ¥ | 4 103 826 | € | 25 420 | | 0 | (0,03) |
| | 01/2024 | NOK | 117 693 | | 10 035 | | 0 | (0,01) |
| | 01/2024 | SEK | 196 329 | | 17 273 | | 0 | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 36 821 | | 33 691 | | 367 | 0,01 |
| | 02/2024 | | 74 362 | BRL | 379 806 | | 3 344 | 0,10 |
| JPM | 03/2024 | 1 614 | TRY | 50 700 | | 0 | (16) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 82 687 | \$ | 2 617 | | 0 | (0,00) |
| | 03/2024 | \$ | 118 | CNH | 850 | | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 14 545 | INR | 1 215 982 | | 15 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 11 000 | TWD | 341 994 | | 300 | 0,01 |
| MBC | 06/2024 | KRW | 4 859 238 | \$ | 3 747 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | AUD | 9 781 | € | 5 982 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | € | 1 502 | CAD | 2 206 | | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 288 | £ | 2 828 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | | 29 506 | \$ | 32 308 | | 0 | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 57 590 | COP | 232 669 704 | | 2 004 | 0,06 |
| | 01/2024 | | 90 356 | HUF | 33 148 534 | | 4 676 | 0,14 |
| MYI | 03/2024 | 53 | TWD | 1 674 | | 2 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF | 29 742 | € | 31 515 | | 0 | (0,02) |
| | 01/2024 | € | 1 844 | CAD | 2 720 | | 23 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 735 | £ | 3 222 | | 1 | (0,00) |
| | 01/2024 | | 24 844 | \$ | 27 254 | | 1 | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 454 | € | 522 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | \$ | 118 894 | | 108 912 | | 1 306 | 0,04 |
| | 02/2024 | | 69 | CNY | 490 | | 0 | 0,00 |
| RYL | 06/2024 | KRW | 3 128 221 | \$ | 2 405 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | € | 1 421 | CAD | 2 085 | | 10 | 0,00 |
| | 03/2024 | £ | 99 008 | € | 114 991 | | 1 008 | 0,03 |
| SCX | 01/2024 | CAD | 144 651 | | 96 932 | | 0 | (0,07) |
| | 01/2024 | € | 3 362 | AUD | 5 457 | | 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 9 110 | ¥ | 1 415 500 | | 0 | (0,00) |
| | 01/2024 | £ | 234 045 | € | 269 565 | | 0 | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 36 412 | MXN | 639 308 | | 1 060 | 0,03 |
| | 03/2024 | HKD | 322 019 | \$ | 41 311 | | 0 | (0,00) |
| | 03/2024 | TWD | 2 197 626 | | 69 622 | | 0 | (0,09) |
| | 03/2024 | \$ | 31 656 | INR | 2 647 341 | | 43 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 2 594 887 | \$ | 1 999 | | 0 | (0,00) |
| SSB | 01/2024 | \$ | 85 471 | CLP | 75 558 232 | | 891 | 0,03 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| UAG | 01/2024 | € 1 987 | AUD 3 275 | € 36 | € 0 | € 36 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 786 212 | € 714 761 | 3 196 | 0 | 3 196 | 0,10 |
| | 01/2024 | 5 458 | MXN 95 896 | 163 | 0 | 163 | 0,01 |
| | 01/2024 | 41 653 | ZAR 795 113 | 1 599 | 0 | 1 599 | 0,05 |
| | 03/2024 | ¥ 2 370 000 | € 15 488 | 140 | 0 | 140 | 0,00 |
| | | | | € 27 412 | € (25 291) | € 2 121 | 0,06 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories BM Détail en AUD (couverte) de distribution II et M Détail en AUD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | € 86 | AUD 142 | € 1 | € 0 | € 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 12 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 87 | 144 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 100 | 164 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | € 5 | € 0 | € 5 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 709 | CHF 676 | € 19 | € 0 | € 19 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 33 | 32 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 751 | 721 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 812 | 782 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | CHF 16 | € 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 54 | CHF 51 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 182 | 173 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | € 77 | € 0 | € 77 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 313 | € 365 | € 4 | € 0 | € 4 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 37 | 42 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | € 76 107 | £ 65 629 | 0 | (385) | (385) | (0,01) |
| DUB | 01/2024 | £ 406 | € 473 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | € 83 327 | £ 72 073 | 0 | (169) | (169) | (0,01) |
| JPM | 01/2024 | 155 732 | 134 965 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 6 749 | € 7 868 | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| NGF | 01/2024 | 52 | 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | € 10 341 | £ 8 907 | 1 | (65) | (64) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 1 662 | € 1 923 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | € 154 899 | £ 134 488 | 275 | 0 | 275 | 0,01 |
| | 01/2024 | £ 376 | € 438 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 537 | 626 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | € 381 | € (628) | € (247) | (0,01) |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en ILS (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | € 1 298 | ILS 5 270 | € 27 | € 0 | € 27 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 1 298 | 5 270 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 01/2024 | ILS 44 | € 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | € 8 | ILS 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 26 | 106 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 1 326 | 5 388 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| | | | | € 81 | € 0 | € 81 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devises à livrer | Devises à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 02/2024 | SGD 64 | € 44 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | € 20 115 | SGD 29 303 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 20 116 | 29 303 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD 444 | € 305 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | € 20 116 | SGD 29 303 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD 174 | € 119 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 01/2024 | € 404 | SGD 588 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | € 0 | € (15) | € (15) | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en USD (couverte) de capitalisation, Institutions en USD (couverte) de distribution II, Investisseurs en USD (couverte) de capitalisation, BM Détail en USD (couverte) de distribution II, E en USD (couverte) de capitalisation, E en USD (couverte) de distribution, E en USD (couverte) de distribution II, H Institutions en USD (couverte) de capitalisation, M Détail en USD (couverte) de distribution II et T en USD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devises à livrer | Devises à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | € 1 213 | \$ 1 329 | € 0 | € (11) | € (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 730 | € 5 192 | 18 | (12) | 6 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 88 974 | \$ 97 940 | 0 | (333) | (333) | (0,01) |
| BRC | 01/2024 | 88 974 | 97 852 | 0 | (413) | (413) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 254 | € 234 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 1 093 | 991 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| IND | 01/2024 | 2 552 | 2 321 | 12 | (1) | 11 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 77 741 | \$ 85 004 | 0 | (808) | (808) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 792 | € 727 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 398 | 369 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | 1 082 | 991 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 198 | 184 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | € 12 874 | \$ 14 033 | 0 | (174) | (174) | (0,01) |
| | | | | € 70 | € (1 752) | € (1 682) | (0,05) |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ 79 0,00

Total des Investissements

€ 4 129 840 126,60

Autres actifs et passifs à court terme

€ (867 795) (26,60)

Actifs nets

€ 3 262 045 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 € (31 décembre 2022 : 17 831 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 160 662 € (31 décembre 2022 : 68 086 €) a été nanti en garantie de ventes à découvert d'actions et d'options sur actions ainsi que le prescrivent les contrats de courtage de premier ordre et les contrats régissant les opérations d'options cotées au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 139 157 € (31 décembre 2022 : 287 910 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 20 700 € (31 décembre 2022 : 38 420 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|--------------------|
| Valeurs mobilières | € 350 997 | € 3 029 852 | € 292 | € 3 381 141 |
| Fonds d'investissement | 309 264 | 3 401 | 0 | 312 665 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 358 849 | 0 | 358 849 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 63 704 | 13 481 | 0 | 77 185 |
| Totaux | € 723 965 | € 3 405 583 | € 292 | € 4 129 840 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|--------------------|
| Valeurs mobilières | € 1 030 499 | € 3 100 425 | € 0 | € 4 130 924 |
| Fonds d'investissement | 159 134 | 345 280 | 0 | 504 414 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 124 604 | 0 | 124 604 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 40 774 | (43 246) | 0 | (2 472) |
| Totaux | € 1 230 407 | € 3 527 063 | € 0 | € 4 757 470 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | € (2) | € 0 | € (2) | € 50 | € 0 | € 50 |
| BOA | 686 | (2 500) | (1 814) | 3 446 | (3 570) | (124) |
| BPS | (5 743) | 7 890 | 2 147 | 4 322 | (10 200) | (5 878) |
| BRC | (1 298) | 2 490 | 1 192 | (7 900) | 5 060 | (2 840) |
| CBK | (3 926) | 3 590 | (336) | 10 257 | (9 740) | 517 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (8) | 0 | (8) |
| DUB | 521 | (750) | (229) | 12 986 | (12 970) | 16 |
| GLM | 824 | (730) | 94 | (7 033) | 6 920 | (113) |
| GST | S/O | S/O | S/O | (2) | 0 | (2) |
| IND | 11 | 0 | 11 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | 195 | 1 160 | 1 355 | 7 259 | (7 080) | 179 |
| MBC | 5 541 | (5 910) | (369) | 36 023 | (33 640) | 2 383 |
| MEI | S/O | S/O | S/O | 80 | (4 040) | (3 960) |
| MYI | 738 | (1 120) | (382) | (126) | 0 | (126) |
| RBC | 67 | 2 220 | 2 287 | (3 115) | 2 470 | (645) |
| RYL | 966 | (1 220) | (254) | (7 748) | 7 780 | 32 |
| SCX | (4 364) | 3 350 | (1 014) | (15 297) | 14 720 | (577) |
| SOG | S/O | S/O | S/O | (1 445) | 1 300 | (145) |
| SSB | 897 | 0 | 897 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 4 966 | (8 660) | (3 694) | (341) | 170 | (171) |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 62,16 | 65,24 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 40,00 | 15,48 |
| Autres valeurs mobilières | 1,50 | 0,05 |
| Fonds d'investissement | 9,58 | 9,86 |
| Contrats de mise en pension | 11,00 | 2,44 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 1,64 | 0,48 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,72 | (1,15) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,00 | 0,61 |
| Contrats de prise en pension | S/O | (0,35) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 10,67 | 3,28 |
| Obligations et billets convertibles | 0,32 | 0,26 |
| Agences du gouvernement américain | 32,95 | S/O |
| Obligations du Trésor américain | 3,22 | S/O |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 4,52 | 1,78 |
| Titres adossés à des actifs | 9,07 | 6,77 |
| Émissions souveraines | 7,83 | 0,72 |
| Actions ordinaires | 18,21 | 39,19 |
| Droits | S/O | 0,00 |
| Titres privilégiés | 0,00 | S/O |
| Sociétés d'investissement immobilier | 0,18 | 0,26 |
| Instruments à court terme | 16,69 | 28,51 |
| Fonds d'investissement | 9,58 | 9,86 |
| Contrats de mise en pension | 11,00 | 2,44 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 1,98 | 0,51 |
| Options achetées | | |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | 0,00 | S/O |
| Options sur Indices | 0,02 | 0,00 |
| Options vendues | | |
| Options sur Indices | (0,36) | (0,03) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,20 | 0,30 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,52 | (1,45) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Options de change | S/O | 0,14 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Options de change | S/O | (0,04) |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | (0,05) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,01) | 0,01 |
| Contrats de change à terme | 0,06 | 1,12 |
| Contrats de change à terme couverts | (0,05) | (0,57) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (26,60) | 6,99 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| MAGYAR EXPORT-IMPORT BANK | | | | ISRAËL | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Magyar Export-Import Bank | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | America Movil S.A.B. de C.V. | | | |
| 6,000 % éch. | | | | Obligation internationale du gouvernement israélien | | | | 8,460 % éch. 18/12/2036 | MXN 1 800 | \$ 91 | 0,00 |
| 16/05/2029 (k) | € 6 500 | \$ 7 638 | 0,26 | 5,000 % éch. 30/10/2026 (k) | € 29 000 | \$ 32 786 | 1,14 | Corp. GEO S.A.B. de C.V. | | | |
| Total Hongrie | | 43 691 | 1,52 | CÔTE D'IVOIRE | | | | 8,875 % éch. 25/09/2014 ^ | \$ 250 | 0 | 0,00 |
| INDONÉSIE | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | 9,250 % éch. 30/06/2020 ^ | 700 | 0 | 0,00 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | République de Côte d'Ivoire | | | | Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien | | | | 9,055 % éch. 19/03/2027 | 5 530 | 5 895 | 0,21 | 9,620 % éch. 28/06/2018 | MXN 22 130 | 0 | 0,00 |
| 6,125 % éch. | | | | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. | | | |
| 15/05/2028 | IDR 524 551 000 | 33 673 | 1,17 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 8,790 % éch. 09/12/2014 ^ | 29 700 | 0 | 0,00 |
| 6,375 % éch. | | | | Corsair International Ltd. | | | | | | | |
| 15/08/2028 | 443 530 000 | 28 754 | 1,00 | 8,802 % éch. 28/01/2027 | 3 500 | 3 866 | 0,14 | | | | |
| 6,375 % éch. | | | | 9,152 % éch. 28/01/2029 | 2 700 | 2 983 | 0,10 | | | | |
| 15/04/2032 | 221 556 000 | 14 258 | 0,50 | Total Jersey, Îles Anglo-normandes | | 6 849 | 0,24 | | | | |
| 6,500 % éch. | | | | | | | | | | | |
| 15/02/2031 | 646 184 000 | 41 914 | 1,46 | ACTIONS | | | | | | | |
| 6,875 % éch. | | | | LUXEMBOURG | | | | | | | |
| 15/04/2029 | 62 053 000 | 4 100 | 0,14 | ACTIONS ORDINAIRES | | | | | | | |
| 7,000 % éch. | | | | DrillCo Holding Lux | | | | | | | |
| 15/09/2030 | 472 005 000 | 31 411 | 1,09 | S.A. (d) | 3 120 | 78 | 0,00 | | | | |
| 7,000 % éch. | | | | DrillCo Holding Lux | | | | | | | |
| 15/02/2033 | 157 625 000 | 10 612 | 0,37 | S.A. (d)(j) | 7 882 | 196 | 0,01 | | | | |
| 7,125 % éch. | | | | Total Actions ordinaires | | 274 | 0,01 | | | | |
| 15/06/2038 | 148 515 000 | 10 102 | 0,35 | | | | | | | | |
| 7,125 % éch. | | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | | | | | |
| 15/06/2042 | 34 279 000 | 2 309 | 0,08 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | |
| 7,125 % éch. | | | | Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en | | | | | | | |
| 15/06/2043 | 104 185 000 | 7 026 | 0,24 | numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) | | | | | | | |
| 7,500 % éch. | | | | 3,000 % éch. 31/12/2026 (c) | \$ 344 | 251 | 0,01 | | | | |
| 15/06/2035 | 236 780 000 | 16 446 | 0,57 | FORESEA Holding S.A. | | | | | | | |
| 7,500 % éch. | | | | 7,500 % éch. 15/06/2030 | 137 | 127 | 0,00 | | | | |
| 15/05/2038 | 109 016 000 | 7 586 | 0,26 | | | | | | | | |
| 7,500 % éch. | | | | | | | | | | | |
| 15/04/2040 | 213 559 000 | 14 832 | 0,52 | | | | | | | | |
| 8,250 % éch. | | | | | | | | | | | |
| 15/05/2029 | 83 961 000 | 5 881 | 0,20 | | | | | | | | |
| 8,250 % éch. | | | | | | | | | | | |
| 15/05/2036 | 2 102 000 | 154 | 0,01 | | | | | | | | |
| 8,375 % éch. | | | | | | | | | | | |
| 15/03/2034 | 345 830 000 | 25 405 | 0,88 | | | | | | | | |
| 9,000 % éch. | | | | | | | | | | | |
| 15/03/2029 | 77 897 000 | 5 599 | 0,19 | | | | | | | | |
| Total Indonésie | | 260 062 | 9,03 | | | | | | | | |
| INTERNATIONALES | | | | MALAISIE | | | | | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | |
| Project Mercury | | | | Obligation internationale du gouvernement malaisien | | | | | | | |
| 8,127 % éch. | | | | 2,632 % éch. 15/04/2031 | MYR 41 320 | 8 346 | 0,29 | | | | |
| 11/08/2030 | € 5 000 | 5 540 | 0,19 | 3,502 % éch. 31/05/2027 | 26 980 | 5 870 | 0,20 | | | | |
| State Oil Co. of the Azerbaijan Republic | | | | 3,733 % éch. 15/06/2028 | 38 090 | 8 340 | 0,29 | | | | |
| 8,305 % éch. | | | | 3,757 % éch. 22/05/2040 | 19 662 | 4 101 | 0,14 | | | | |
| 26/11/2024 | \$ 5 467 | 5 425 | 0,19 | 3,885 % éch. 15/08/2029 | 26 300 | 5 789 | 0,20 | | | | |
| Total Internationales | | 10 965 | 0,38 | 3,899 % éch. 16/11/2027 | 38 880 | 8 571 | 0,30 | | | | |
| IRLANDE | | | | 4,065 % éch. 15/06/2050 | 26 115 | 5 555 | 0,19 | | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | 4,232 % éch. 30/06/2031 | 40 000 | 8 962 | 0,31 | | | | |
| Avoca Static CLO DAC | | | | 4,254 % éch. 31/05/2035 | 35 490 | 7 950 | 0,28 | | | | |
| 5,690 % éch. | | | | 4,504 % éch. 30/04/2029 | 6 420 | 1 455 | 0,05 | | | | |
| 15/10/2030 | € 1 000 | 1 104 | 0,04 | 4,696 % éch. 15/10/2042 | 50 917 | 11 967 | 0,42 | | | | |
| Black Diamond CLO DAC | | | | 4,762 % éch. 07/04/2037 | 95 588 | 22 494 | 0,78 | | | | |
| 4,853 % éch. | | | | 4,893 % éch. 08/06/2038 | 17 220 | 4 122 | 0,14 | | | | |
| 20/01/2032 | 544 | 597 | 0,02 | Émission d'investissement du gouvernement malaisien | | | | | | | |
| BNPP AM Euro CLO DAC | | | | 3,422 % éch. 30/09/2027 | 40 470 | 8 757 | 0,31 | | | | |
| 4,565 % éch. | | | | 3,447 % éch. 15/07/2036 | 24 190 | 5 002 | 0,17 | | | | |
| 15/04/2031 | 500 | 544 | 0,02 | 3,465 % éch. 15/10/2030 | 177 660 | 38 004 | 1,32 | | | | |
| Carlyle Euro CLO DAC | | | | 3,599 % éch. 31/07/2028 | 24 600 | 5 357 | 0,19 | | | | |
| 4,665 % éch. | | | | 4,070 % éch. 30/09/2026 | 153 961 | 34 035 | 1,18 | | | | |
| 15/01/2031 | 4 561 | 4 990 | 0,17 | 4,130 % éch. 09/07/2029 | 5 910 | 1 314 | 0,05 | | | | |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | | 4,245 % éch. 30/09/2030 | 56 920 | 12 756 | 0,44 | | | | |
| 4,752 % éch. | | | | 4,369 % éch. 31/10/2028 | 38 880 | 8 740 | 0,30 | | | | |
| 15/11/2031 | 1 896 | 2 066 | 0,07 | 4,417 % éch. 30/09/2041 | 33 593 | 7 577 | 0,26 | | | | |
| Dryden Euro CLO DAC | | | | 4,582 % éch. 30/08/2033 | 18 490 | 4 287 | 0,15 | | | | |
| 4,862 % éch. | | | | 5,357 % éch. 15/05/2052 | 12 777 | 3 243 | 0,11 | | | | |
| 15/05/2034 | 7 387 | 8 036 | 0,28 | Total Malaisie | | 232 594 | 8,07 | | | | |
| Total Irlande | | 17 337 | 0,60 | ACTIONS | | | | | | | |
| | | | | MEXIQUE | | | | | | | |
| | | | | ACTIONS ORDINAIRES | | | | | | | |
| | | | | Hipotecaria Su Casita | | | | | | | |
| | | | | S.A. de C.V. (d) | 212 074 | 0 | 0,00 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| POLOGNE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement polonais | | | |
| 1,250 % éch. 25/10/2030 | PLN 2 486 | \$501 | 0,02 |
| 1,750 % éch. 25/04/2032 (k) | 50 900 | 10 070 | 0,35 |
| 2,500 % éch. 25/07/2027 (k) | 65 700 | 15 446 | 0,53 |
| 2,750 % éch. 25/04/2028 (k) | 243 700 | 56 870 | 1,97 |
| 2,750 % éch. 25/10/2029 (k) | 107 700 | 24 471 | 0,85 |
| 3,750 % éch. 25/05/2027 (k) | 201 200 | 49 320 | 1,71 |
| 6,000 % éch. 25/10/2033 (k) | 120 400 | 32 477 | 1,13 |
| 7,500 % éch. 25/07/2028 (k) | 97 600 | 27 328 | 0,95 |
| Total Pologne | | 216 483 | 7,51 |
| QATAR | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| QNB Finance Ltd. | | | |
| 6,900 % éch. 23/01/2025 | IDR 276 200 000 | 17 912 | 0,62 |
| ROUMANIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement roumain | | | |
| 4,150 % éch. 26/01/2028 | RON 153 900 | 31 805 | 1,11 |
| 4,250 % éch. 28/04/2036 | 103 700 | 19 108 | 0,66 |
| 4,750 % éch. 11/10/2034 | 62 000 | 12 150 | 0,42 |
| 5,000 % éch. 12/02/2029 | 12 600 | 2 652 | 0,09 |
| 6,375 % éch. 18/09/2033 (k) | € 3 800 | 4 447 | 0,16 |
| 7,350 % éch. 28/04/2031 | RON 41 600 | 9 799 | 0,34 |
| Total Roumanie | | 79 961 | 2,78 |
| RUSSIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement russe | | | |
| 7,700 % éch. 23/03/2033 ^ | RUB 1 088 800 | 4 476 | 0,16 |
| SERBIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement serbe | | | |
| 4,500 % éch. 20/08/2032 | RSD 371 800 | 3 136 | 0,11 |
| AFRIQUE DU SUD | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banque de développement d'Afrique du Sud | | | |
| 8,600 % éch. 21/10/2024 (j) | ZAR 221 300 | 12 064 | 0,42 |
| Eskom Holdings SOC Ltd. | | | |
| 0,000 % éch. 18/08/2027 (e) | 100 100 | 3 109 | 0,11 |
| 0,000 % éch. 31/12/2032 (e) | 254 000 | 3 007 | 0,10 |
| 7,850 % éch. 02/04/2026 | 6 000 | 319 | 0,01 |
| | | 18 499 | 0,64 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | |
| 2,000 % éch. 31/01/2025 (g) | 71 535 | 3 826 | 0,13 |
| 6,250 % éch. 31/03/2036 | 114 500 | 4 116 | 0,14 |
| 6,500 % éch. 28/02/2041 | 184 751 | 6 117 | 0,21 |
| 7,000 % éch. 28/02/2031 | ZAR 588 446 | \$26 960 | 0,94 |
| 8,000 % éch. 31/01/2030 | 1 967 327 | 99 011 | 3,44 |
| 8,250 % éch. 31/03/2032 | 498 080 | 23 799 | 0,83 |
| 8,500 % éch. 31/01/2037 | 697 900 | 29 780 | 1,03 |
| 8,750 % éch. 31/01/2044 | 432 400 | 17 546 | 0,61 |
| 8,875 % éch. 28/02/2035 | 213 800 | 9 870 | 0,34 |
| 9,000 % éch. 31/01/2040 | 489 800 | 20 889 | 0,73 |
| 10,500 % éch. 21/12/2026 | 1 916 532 | 109 713 | 3,81 |
| | | 351 627 | 12,21 |
| Total Afrique du Sud | | 370 126 | 12,85 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| SUPRANATIONALES | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banque de développement asiatique | | | |
| 4,700 % éch. 12/03/2024 | MXN 68 600 | 3 995 | 0,14 |
| Banque internationale pour la reconstruction et le développement | | | |
| 6,250 % éch. 12/01/2028 | IDR 191 500 000 | 12 478 | 0,43 |
| Total Supranationales | | 16 473 | 0,57 |
| TANZANIE | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | | | |
| 6,915 % éch. 28/06/2024 | € 17 000 | 18 788 | 0,65 |
| Ministère des Finances et de la Planification, Gouvernement de la République unie de Tanzanie | | | |
| 9,502 % éch. 26/04/2028 | 7 364 | 8 073 | 0,28 |
| Total Tanzanie | | 26 861 | 0,93 |
| THAÏLANDE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais | | | |
| 2,000 % éch. 17/06/2042 | THB 145 900 | 3 624 | 0,13 |
| 2,250 % éch. 17/03/2027 | 1 681 280 | 49 051 | 1,70 |
| 2,400 % éch. 17/03/2029 | 1 932 209 | 56 465 | 1,96 |
| 2,650 % éch. 17/06/2028 | 504 571 | 14 922 | 0,52 |
| 3,300 % éch. 17/06/2038 | 480 990 | 14 562 | 0,50 |
| 3,350 % éch. 17/06/2033 | 447 020 | 13 814 | 0,48 |
| 3,390 % éch. 17/06/2037 | 1 339 685 | 41 599 | 1,44 |
| 3,400 % éch. 17/06/2036 | 415 204 | 12 657 | 0,44 |
| 3,450 % éch. 17/06/2043 | 524 575 | 16 109 | 0,56 |
| 3,775 % éch. 25/06/2032 | 108 429 | 3 459 | 0,12 |
| 4,875 % éch. 22/06/2029 | 438 082 | 14 388 | 0,50 |
| Total Thaïlande | | 240 650 | 8,35 |
| TURQUIE | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | |
| SOCAR Turkey Enerji A/S | | | |
| 7,387 % éch. 11/08/2026 | € 12 200 | 13 308 | 0,46 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement turc | | | |
| 26,200 % éch. 05/10/2033 | TRY 241 300 | 8 488 | 0,30 |
| Total Turquie | | 21 796 | 0,76 |
| UKRAÏNE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien | | | |
| 7,253 % éch. 15/03/2035 | \$ 7 800 | \$1 853 | 0,07 |
| 7,750 % éch. 01/08/2041 | 4 600 | 2 071 | 0,07 |
| Total Ukraine | | 3 924 | 0,14 |
| ÉMIRATS ARABES UNIS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ADCB Finance Cayman Ltd. | | | |
| 7,500 % éch. 15/10/2029 | IDR 29 000 000 | 1 917 | 0,06 |
| 8,160 % éch. 29/04/2029 | 323 000 000 | 21 797 | 0,76 |
| | | 23 714 | 0,82 |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | |
| NMC Healthcare LLC | | | |
| 11,640 % éch. 25/03/2025 | AED 12 368 | 3 426 | 0,12 |
| 11,640 % éch. 25/03/2027 | 16 490 | 4 569 | 0,16 |
| | | 7 995 | 0,28 |
| Total Émirats arabes unis | | 31 709 | 1,10 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ROYAUME-UNI | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Petra Diamonds U.S. Treasury PLC | | | |
| 9,750 % éch. 08/03/2026 | \$ 859 | 657 | 0,02 |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Canada Square Funding PLC | | | |
| 6,070 % éch. 17/01/2059 | £ 1 568 | 1 988 | 0,07 |
| Rochester Financing PLC | | | |
| 5,920 % éch. 18/12/2044 | 1 513 | 1 914 | 0,07 |
| Stratton Mortgage Funding PLC | | | |
| 6,120 % éch. 12/03/2052 | 344 | 438 | 0,01 |
| Tower Bridge Funding PLC | | | |
| 5,940 % éch. 20/12/2063 | 740 | 938 | 0,03 |
| Warwick Finance Residential Mortgages PLC | | | |
| 0,000 % éch. 21/12/2049 (e) | 0 | 516 | 0,02 |
| | | 5 794 | 0,20 |
| Total Royaume-Uni | | 6 451 | 0,22 |
| ÉTATS-UNIS | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,790 % éch. 25/12/2036 | \$ 1 226 | 685 | 0,02 |
| 6,070 % éch. 25/10/2036 | 423 | 248 | 0,01 |
| GSAMP Trust | | | |
| 5,520 % éch. 25/12/2046 | 440 | 218 | 0,01 |
| 5,560 % éch. 25/01/2037 | 854 | 493 | 0,02 |
| Lehman XS Trust | | | |
| 5,011 % éch. 25/01/2036 | 1 483 | 1 303 | 0,05 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 6,620 % éch. 25/08/2037 | 629 | 535 | 0,02 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | |
| 5,700 % éch. 25/11/2036 | 6 926 | 3 948 | 0,14 |
| 5,770 % éch. 25/06/2036 | 163 | 135 | 0,00 |
| 6,625 % éch. 25/01/2035 | 1 732 | 1 604 | 0,06 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust | | | |
| 5,810 % éch. 25/01/2037 | 1 714 | 605 | 0,02 |
| Option One Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,690 % éch. 25/04/2037 | 465 | 311 | 0,01 |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass- Through Certificates | | | |
| 6,205 % éch. 25/08/2035 | 77 | 75 | 0,00 |
| Residential Asset Securities Corp. Trust | | | |
| 7,120 % éch. 25/07/2035 | 2 085 | 2 063 | 0,07 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,690 % éch. 25/10/2037 | 4 957 | 3 099 | 0,11 |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 5,790 % éch. 25/07/2036 | 1 300 | 1 244 | 0,04 |
| | | 16 566 | 0,58 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 684 300 | \$ (2 199) | (0,08) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|---|------------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 % | 20/10/2033 | £ 800 | \$ 89 | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 168 200 | 3 094 | 0,11 |
| À payer ⁽³⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2029 | INR 1 978 230 | 60 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2034 | 1 369 700 | (77) | 0,00 |
| À payer | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,600 | 20/12/2033 | 859 590 | 237 | 0,01 |
| À recevoir | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,621 | 20/12/2028 | 1 148 310 | (209) | (0,01) |
| À recevoir | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,625 | 20/12/2025 | 3 168 130 | (189) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,232 | 05/10/2025 | ¥ 41 960 000 | (550) | (0,02) |
| À recevoir ⁽³⁾ | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,350 | 21/03/2026 | 40 895 000 | (692) | (0,02) |
| À recevoir | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 3,322 | 20/12/2028 | SGD 11 820 | (96) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,250 | 20/03/2026 | THB 2 103 541 | (18) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 20/03/2026 | 7 375 510 | 836 | 0,03 |
| À recevoir ⁽³⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 20/03/2029 | 871 019 | 16 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 20/03/2029 | 2 901 970 | (1 122) | (0,04) |
| À payer | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,770 | 20/12/2028 | 214 600 | 125 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | \$ 26 400 | 847 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 4 000 | (465) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 3 900 | (186) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 23 660 | 2 029 | 0,07 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 8 400 | (500) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2035 | 3 800 | 132 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 2 400 | (33) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730 | 03/08/2033 | 2 800 | 50 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735 | 07/08/2033 | 3 100 | 59 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 82 800 | (2 675) | (0,09) |
| À payer ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 86 900 | 373 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 2 400 | (47) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 2 200 | (54) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 1 200 | 118 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 1 800 | (48) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 4 700 | (132) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870 | 17/10/2053 | 2 000 | 212 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880 | 16/10/2053 | 500 | 54 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 3 600 | (129) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 900 | 42 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 3 000 | (126) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 3 200 | 184 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155 | 02/10/2033 | 5 700 | 327 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165 | 27/09/2033 | 5 200 | 302 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 7 000 | 410 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 4 000 | 236 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 2 400 | 152 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 | 23/10/2033 | 1 900 | 122 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 4 600 | (273) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255 | 23/10/2033 | 2 200 | 146 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 2 300 | 190 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 2 600 | 217 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 4 200 | 353 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 4,870 | 02/01/2024 | BRL 242 300 | (5 019) | (0,17) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 5,680 | 02/01/2024 | 19 200 | (341) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 6,151 | 04/01/2027 | 528 200 | (10 028) | (0,35) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 8,075 | 02/01/2024 | 120 000 | 2 039 | 0,07 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,630 | 04/01/2027 | 85 900 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,830 | 02/01/2026 | 540 400 | 341 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,076 | 04/01/2027 | 325 100 | (54) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,164 | 02/01/2026 | 14 390 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,512 | 04/01/2027 | 115 000 | 388 | 0,01 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,529 | 02/01/2026 | 178 300 | (404) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,583 | 02/01/2029 | 67 500 | (298) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,602 | 04/01/2027 | 259 100 | 564 | 0,02 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,691 | 02/01/2026 | 193 000 | 596 | 0,02 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,751 | 02/01/2026 | 73 100 | 241 | 0,01 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,768 | 04/01/2027 | 59 800 | (266) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,792 | 04/01/2027 | 356 400 | 1 537 | 0,05 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,811 | 02/01/2025 | 542 910 | (88) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,872 | 04/01/2027 | 135 200 | (663) | (0,02) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,064 | 04/01/2027 | 259 100 | 1 473 | 0,05 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,169 | 04/01/2027 | 96 950 | 1 077 | 0,04 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,439 | 02/01/2029 | 80 100 | 293 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notional | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,040 % | 01/04/2024 | BRL 1 275 900 | \$ (81) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,260 | 01/04/2024 | 1 117 600 | (74) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,350 | 01/07/2024 | 288 000 | (101) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,490 | 01/07/2024 | 312 400 | (199) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,080 | 01/07/2024 | 542 300 | 1 019 | 0,03 |
| À payer ⁽³⁾ | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | CNY 516 220 | 91 | 0,00 |
| À payer | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,405 | 20/12/2028 | 118 100 | 109 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 4,115 | 01/02/2031 | COP 14 558 000 | 171 | 0,01 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 4,120 | 01/02/2031 | 10 388 000 | 123 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 4,155 | 15/01/2031 | 5 060 000 | 66 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 5,675 | 18/06/2031 | 20 000 000 | 472 | 0,02 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,380 | 21/01/2029 | 9 688 000 | 35 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,590 | 17/07/2033 | 66 033 000 | 231 | 0,01 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,680 | 17/07/2028 | 111 053 000 | (141) | (0,01) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,705 | 26/03/2031 | 62 868 510 | (194) | (0,01) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,020 | 04/12/2030 | 24 925 400 | (166) | (0,01) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,215 | 14/11/2028 | 81 386 200 | (376) | (0,01) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,820 | 05/06/2028 | 50 580 700 | 255 | 0,01 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,050 | 03/10/2028 | 21 836 600 | 284 | 0,01 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,300 | 26/03/2031 | 35 440 700 | (883) | (0,03) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,490 | 30/06/2032 | 6 936 040 | 203 | 0,01 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,790 | 20/01/2028 | 45 916 600 | 797 | 0,03 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,800 | 17/01/2028 | 54 120 000 | 936 | 0,03 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,820 | 27/02/2033 | 9 049 540 | (315) | (0,01) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,130 | 25/01/2028 | 42 970 500 | 887 | 0,03 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,400 | 21/11/2029 | 3 111 360 | (106) | 0,00 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,590 | 18/05/2028 | ILS 28 600 | (283) | (0,01) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,792 | 06/11/2028 | 38 100 | (60) | 0,00 |
| À payer | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,580 | 20/12/2033 | KRW 8 804 430 | 303 | 0,01 |
| À recevoir | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,700 | 20/12/2025 | 35 867 400 | (194) | (0,01) |
| À payer | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,820 | 20/12/2028 | 40 181 300 | 1 191 | 0,04 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,205 | 22/04/2027 | ZAR 178 200 | 182 | 0,01 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,210 | 22/04/2027 | 137 000 | 138 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,565 | 22/03/2026 | 300 200 | 62 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,808 | 28/11/2025 | 272 900 | 17 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,070 | 30/11/2028 | 83 300 | (10) | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,120 | 13/03/2028 | 4 890 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,140 | 16/11/2028 | 268 100 | (77) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,185 | 31/07/2026 | 106 600 | (60) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,195 | 21/12/2026 | 505 800 | (321) | (0,01) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,276 | 28/02/2028 | 263 600 | 209 | 0,01 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 13/07/2025 | 312 500 | (12) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 10/11/2028 | 260 400 | (236) | (0,01) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,440 | 02/11/2028 | 366 800 | 330 | 0,01 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,500 | 21/12/2026 | 330 800 | 357 | 0,01 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,530 | 31/01/2030 | 120 000 | (72) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,548 | 31/01/2030 | 120 000 | (78) | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,650 | 31/10/2028 | 82 100 | 120 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,650 | 31/01/2030 | 64 630 | (60) | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,670 | 21/12/2026 | 363 400 | 482 | 0,02 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,695 | 31/01/2030 | 141 100 | (148) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,700 | 31/01/2030 | 140 400 | (149) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,735 | 31/01/2030 | 110 200 | (127) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,820 | 31/01/2030 | 95 300 | (132) | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,220 | 28/11/2033 | 86 100 | 17 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,290 | 26/05/2028 | 221 400 | (187) | (0,01) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,455 | 31/01/2030 | 41 200 | 128 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,470 | 31/01/2030 | 400 000 | 1 261 | 0,04 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 10,150 | 18/05/2033 | 121 800 | 501 | 0,02 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,390 | 30/12/2028 | AUD 74 740 | 1 067 | 0,04 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2028 | 264 690 | 4 361 | 0,15 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,420 | 01/09/2030 | CLP 1 005 150 | 82 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,410 | 01/09/2030 | 2 839 400 | 119 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,640 | 01/10/2028 | 4 335 000 | 9 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,030 | 20/03/2033 | 5 309 140 | 3 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,160 | 01/10/2028 | 6 310 500 | (63) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,175 | 01/10/2028 | 9 739 070 | (105) | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,175 | 29/11/2033 | 2 062 000 | 28 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,220 | 01/10/2028 | 4 896 800 | (69) | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,230 | 17/11/2033 | 721 200 | 20 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,240 | 01/09/2030 | 3 103 000 | (46) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,260 | 17/11/2028 | 4 919 000 | (110) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,300 | 18/05/2033 | 2 475 470 | (79) | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,310 | 16/11/2028 | 3 386 800 | 87 | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,320 | 16/11/2028 | 1 693 500 | 45 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,350 | 01/09/2030 | 4 575 000 | (106) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,360 | 18/05/2033 | 2 594 000 | (98) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,400 | 01/04/2033 | 3 613 700 | (123) | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,400 | 16/11/2033 | 4 525 900 | 180 | 0,01 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,500 | 13/11/2028 | 4 865 500 | (111) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,550 | 01/10/2028 | 3 722 930 | (85) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,690 | 01/09/2030 | 598 400 | (31) | 0,00 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,780 % | 03/10/2028 | CLP 4 803 000 | \$ (205) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,790 | 06/10/2033 | 8 590 000 | (622) | (0,02) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,820 | 01/09/2030 | 1 514 470 | (87) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,855 | 05/10/2033 | 8 427 000 | (638) | (0,02) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,870 | 11/10/2033 | 4 522 700 | (355) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,890 | 29/11/2025 | 7 606 200 | (60) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,920 | 02/10/2028 | 1 891 000 | (93) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,940 | 20/10/2033 | 1 991 300 | (171) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,990 | 20/10/2033 | 18 919 110 | (1 701) | (0,06) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,000 | 02/10/2028 | 3 721 000 | (199) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,146 | 30/10/2032 | 32 521 400 | (3 296) | (0,11) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,235 | 26/10/2033 | 5 823 100 | (660) | (0,02) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,070 | 23/11/2028 | CZK 255 900 | (17) | 0,00 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,388 | 15/11/2028 | 257 400 | (300) | (0,01) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,611 | 06/06/2028 | 441 490 | 1 023 | 0,04 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 12 700 | (1 445) | (0,05) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 4 000 | (60) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 4 900 | (99) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 5 200 | (177) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 3 000 | (110) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 8 600 | (188) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 3 300 | (81) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,970 | 15/12/2033 | 4 300 | (178) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 3 700 | (160) | (0,01) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 37 600 | 2 139 | 0,07 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 3 600 | (181) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,100 | 20/09/2030 | 40 700 | 1 777 | 0,06 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,128 | 04/12/2033 | 2 500 | (140) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 3 200 | (183) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 3 200 | (109) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 38 400 | 601 | 0,02 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 800 | (30) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 08/11/2028 | 6 800 | (254) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 2 200 | (154) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 20 600 | 1 642 | 0,06 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 500 | (36) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,329 | 27/10/2033 | 29 300 | 2 182 | 0,08 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 1 500 | 68 | 0,00 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 1,500 | 19/06/2024 | HUF 5 281 500 | (300) | (0,01) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 1,760 | 21/01/2030 | 1 296 900 | 235 | 0,01 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 2,420 | 02/08/2026 | 3 964 700 | (1 588) | (0,06) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 2,680 | 29/06/2031 | 1 938 800 | (576) | (0,02) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 4,790 | 17/01/2027 | 7 857 000 | (999) | (0,04) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 7,330 | 06/11/2028 | 1 824 800 | 129 | 0,00 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 7,610 | 03/11/2028 | 2 414 000 | 478 | 0,02 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,670 | 23/05/2029 | 1 828 200 | 933 | 0,03 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 8,700 | 16/01/2028 | 1 002 200 | (333) | (0,01) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,740 | 28/04/2028 | 1 920 800 | 556 | 0,02 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 9,230 | 26/08/2032 | 1 440 400 | 884 | 0,03 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 0,925 | 16/10/2030 | PLN 1 500 | (44) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 1,460 | 28/05/2026 | 67 700 | (281) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 2,585 | 14/10/2029 | 15 200 | 289 | 0,01 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 2,920 | 13/12/2031 | 3 800 | 97 | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,075 | 07/03/2027 | 37 000 | 22 | 0,00 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 4,560 | 06/11/2028 | 25 600 | 120 | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,680 | 03/11/2028 | 14 200 | (67) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,710 | 25/05/2027 | 73 900 | (380) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,735 | 09/10/2028 | 62 400 | (206) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,740 | 25/10/2033 | 46 000 | (244) | (0,01) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 4,885 | 30/11/2033 | 17 800 | 121 | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,910 | 25/07/2027 | 29 920 | (49) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,220 | 30/11/2025 | 75 900 | (51) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,220 | 20/03/2033 | 4 100 | (86) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,310 | 21/03/2033 | 40 800 | (771) | (0,03) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,870 | 22/04/2027 | 1 000 | (18) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,960 | 25/04/2027 | 67 900 | (1 274) | (0,04) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,456 | 25/05/2027 | 20 800 | (487) | (0,02) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,480 | 25/05/2027 | 45 100 | (1 069) | (0,04) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,560 | 25/05/2027 | 15 800 | (386) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,830 | 19/08/2024 | 52 600 | (79) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,890 | 22/08/2024 | 119 500 | (200) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 7,310 | 30/06/2027 | 15 300 | (483) | (0,02) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,035 | 31/05/2029 | MXN 42 010 | 55 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,300 | 16/06/2028 | 437 770 | (203) | (0,01) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,400 | 23/11/2034 | 10 100 | 4 | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,700 | 17/11/2033 | 79 700 | (76) | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,720 | 01/03/2029 | 228 800 | (80) | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,828 | 16/11/2033 | 304 500 | (445) | (0,02) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 9,295 | 30/10/2028 | 291 300 | (357) | (0,01) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 9,440 | 04/03/2027 | 485 300 | 309 | 0,01 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 9,620 | 21/09/2033 | 311 500 | 1 053 | 0,04 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 10,055 % | 04/03/2027 | MXN 248 000 | \$ 412 | 0,01 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 10,090 | 04/03/2027 | 130 800 | 225 | 0,01 |
| | | | | | \$ (1 875) | (0,06) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (4 074) | (0,14) |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - USD contre INR hors cote | INR 92,600 | 16/06/2025 | 2 200 | \$ 132 | \$ 10 | (0,00) |
| | Option de vente - USD contre INR hors cote | 92,600 | 16/06/2025 | 2 200 | 132 | 180 | 0,01 |
| GLM | Option d'achat - USD contre JPY hors cote | ¥ 167,000 | 05/11/2024 | 9 422 | 482 | 167 | 0,00 |
| JPM | Option de vente - EUR contre PLN hors cote | PLN 4,400 | 22/08/2024 | 3 065 | 768 | 1 785 | 0,06 |
| MYI | Option de vente - GBP contre USD hors cote | \$ 1,160 | 12/06/2024 | 109 508 | 435 | 234 | 0,01 |
| | | | | | \$ 1 949 | \$ 2 376 | 0,08 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - USD contre BRL hors cote | BRL 4,923 | 26/06/2024 | 17 100 | \$ (706) | \$ (655) | (0,02) |
| | Option de vente - USD contre BRL hors cote | 4,923 | 26/06/2024 | 17 100 | (706) | (607) | (0,02) |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 17,449 | 26/06/2024 | 17 100 | (591) | (576) | (0,02) |
| | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 17 100 | (591) | (593) | (0,02) |
| CBK | Option d'achat - USD contre BRL hors cote | BRL 4,968 | 20/06/2024 | 51 900 | (2 155) | (1 747) | (0,06) |
| | Option de vente - USD contre BRL hors cote | 4,968 | 20/06/2024 | 51 900 | (2 155) | (2 085) | (0,07) |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 17,450 | 01/07/2024 | 15 800 | (551) | (546) | (0,02) |
| | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,450 | 01/07/2024 | 15 800 | (551) | (548) | (0,02) |
| DUB | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | TRY 40,385 | 28/10/2024 | 3 287 | (330) | (220) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,385 | 28/10/2024 | 3 287 | (330) | (354) | (0,01) |
| GLM | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 40,250 | 30/10/2024 | 3 318 | (333) | (228) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,250 | 30/10/2024 | 3 318 | (333) | (349) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 39,800 | 31/10/2024 | 1 664 | (167) | (121) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 39,800 | 31/10/2024 | 1 664 | (167) | (161) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 40,930 | 07/11/2024 | 1 705 | (161) | (115) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,930 | 07/11/2024 | 1 705 | (161) | (195) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 41,150 | 07/11/2024 | 1 705 | (161) | (113) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 41,150 | 07/11/2024 | 1 705 | (161) | (202) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 41,160 | 11/11/2024 | 1 701 | (161) | (115) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 41,160 | 11/11/2024 | 1 701 | (161) | (199) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 04/03/2024 | 7 469 | (104) | (217) | (0,01) |
| JPM | Option d'achat - USD contre IDR hors cote | IDR 14 950,000 | 06/06/2024 | 7 776 | (263) | (311) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre IDR hors cote | 14 950,000 | 06/06/2024 | 7 776 | (238) | (52) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 01/03/2024 | 20 196 | (273) | (581) | (0,02) |
| MYI | Option d'achat - USD contre IDR hors cote | IDR 15 370,000 | 13/08/2024 | 15 626 | (499) | (431) | (0,02) |
| | Option de vente - USD contre IDR hors cote | 15 370,000 | 13/08/2024 | 15 626 | (499) | (304) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 19,500 | 07/03/2024 | 22 599 | (256) | (35) | 0,00 |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 23 800 | (823) | (803) | (0,03) |
| | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 23 800 | (823) | (824) | (0,03) |
| SOG | Option de vente - EUR contre PLN hors cote | PLN 4,220 | 15/03/2024 | 52 060 | (290) | (127) | 0,00 |
| | Option d'achat - EUR contre PLN hors cote | 4,430 | 15/03/2024 | 52 060 | (355) | (430) | (0,02) |
| | | | | | \$ (15 055) | \$ (13 844) | (0,48) |

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 % | 08/01/2024 | 900 | \$ (4) | \$ (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 4 800 | (22) | (60) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 900 | (4) | 0 | 0,00 |

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| CBK | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 % | 16/01/2024 | 4 800 | \$ (22) | \$ (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 800 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 800 | (3) | (2) | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 3 500 | (13) | (39) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 3 500 | (13) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,273 | 16/01/2024 | 5 000 | (21) | (14) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 2 700 | (12) | (35) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,723 | 16/01/2024 | 5 000 | (21) | (8) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 2 700 | (12) | (1) | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 1 400 | (6) | (4) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 1 700 | (7) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 2 200 | (10) | (36) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 1 400 | (6) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 1 700 | (7) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 3 700 | (9) | (13) | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 3 700 | (8) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 2 300 | (10) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 2 300 | (10) | (12) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,490 | 12/01/2024 | 3 600 | (14) | (28) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 4 300 | (16) | (68) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 3 600 | (14) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 4 300 | (16) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 900 | (4) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 1 000 | (5) | (16) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 900 | (4) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 1 000 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 1 400 | (6) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 1 400 | (6) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (313) | \$ (381) | (0,01) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK | Obligation internationale du gouvernement turc | (1,000) % | 20/12/2024 | \$ 2 700 | \$ 165 | \$ (177) | \$ (12) | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK | Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 12 000 | \$ (371) | \$ 339 | \$ (32) | 0,00 |
| DUB | Escom Holdings SOC Ltd. | 4,650 | 30/06/2029 | 11 200 | 0 | 972 | 972 | 0,03 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2024 | 3 400 | 15 | 1 | 16 | 0,00 |
| JPM | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | 6 500 | (146) | 143 | (3) | 0,00 |
| | | | | | \$ (502) | \$ 1 455 | \$ 953 | 0,03 |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVICES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|---|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,053 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/06/2025 | \$ 107 616 | PHP 6 147 000 | \$ (561) | \$ (850) | \$ (1 411) | (0,05) |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|---|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GLM | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,053 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | \$ 13 274 | PHP 737 900 | \$ (2) | \$ (134) | \$ (136) | 0,00 |
| | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,061 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR IDR à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 38 086 | IDR 596 123 530 | (78) | (369) | (447) | (0,02) |
| | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,051 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 4 357 | PHP 242 866 | 5 | (14) | (9) | 0,00 |
| | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,053 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 4 376 | 243 240 | (1) | (44) | (45) | 0,00 |
| | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,056 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/06/2025 | 16 657 | 947 960 | (19) | (185) | (204) | (0,01) |
| JPM | Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,330 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 28/05/2024 | 1 900 | ARS 85 633 | 0 | 1 842 | 1 842 | 0,07 |
| | Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,333 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 30/05/2024 | 4 820 | 214 249 | (15) | 4 688 | 4 673 | 0,17 |
| | Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,282 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 07/06/2027 | 2 090 | 93 789 | (3) | 2 078 | 2 075 | 0,07 |
| | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,054 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 13 078 | PHP 724 510 | 3 | (200) | (197) | (0,01) |
| | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,056 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/06/2025 | 16 923 | 963 240 | (22) | (186) | (208) | (0,01) |
| | | | | | | \$ (693) | \$ 6 626 | \$ 5 933 | 0,21 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir ⁽¹⁾ | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/03/2029 | MYR 50 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 1,950 | 20/06/2028 | ILS 28 900 | 0 | (392) | (392) | (0,01) |
| BSH | À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,300 | 21/06/2029 | CLP 3 450 000 | 0 | 273 | 273 | 0,01 |

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| | Indice de taux variable | | | | | | | | |
| CBK | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,750 % | 22/03/2026 | CLP 8 000 000 | \$ 0 | \$ (410) | \$ (410) | (0,01) |
| | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,790 | 14/03/2026 | 3 885 000 | 7 | (208) | (201) | (0,01) |
| GLM | À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 5,960 | 10/05/2029 | COP 27 236 900 | 0 | 511 | 511 | 0,02 |
| | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,763 | 24/05/2029 | CLP 1 841 700 | 10 | (188) | (178) | (0,01) |
| GST | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,770 | 19/03/2026 | 64 800 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,708 | 02/01/2025 | BRL 18 800 | 0 | 4 | 4 | 0,00 |
| JPM | À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,015 | 20/06/2026 | CLP 5 555 000 | 0 | 304 | 304 | 0,01 |
| | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,265 | 14/06/2029 | 4 122 200 | 0 | (341) | (341) | (0,01) |
| MYC | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,830 | 22/05/2029 | 7 729 900 | 0 | (424) | (424) | (0,02) |
| | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,095 | 01/06/2027 | 12 230 000 | 0 | (377) | (377) | (0,01) |
| MYC | À payer ⁽¹⁾ | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,319 | 22/05/2029 | 19 808 000 | 0 | (127) | (127) | 0,00 |
| | À payer ⁽¹⁾ | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/03/2027 | MYR 476 920 | 64 | 31 | 95 | 0,00 |
| MYC | À recevoir ⁽¹⁾ | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/03/2029 | 481 150 | 469 | (62) | 407 | 0,01 |
| | À payer | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,868 | 20/12/2028 | 28 100 | 0 | 82 | 82 | 0,00 |
| MYC | À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,540 | 04/06/2029 | CLP 4 115 000 | 0 | 284 | 284 | 0,01 |
| | À payer | CDI BRL à 1 an | 7,800 | 04/01/2027 | BRL 12 200 | 17 | (117) | (100) | 0,00 |
| | | | | | | \$ 567 | \$ (1 160) | \$ (593) | (0,02) |

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| | | | | | | | |
| BOA | 03/2024 | CNH 12 314 | \$ 1 708 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 01/2024 | CLP 1 964 976 | 2 256 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | DOP 141 594 | 2 473 | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 381 | 484 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | HUF 7 266 296 | 19 860 | 0 | (1 080) | (1 080) | (0,04) |
| | 01/2024 | KZT 1 731 131 | 3 636 | 0 | (133) | (133) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | PEN 101 314 | 27 303 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 18 631 | 4 355 | 0 | (382) | (382) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | \$ 384 | AUD 581 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 366 | COP 16 699 329 | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 7 129 | HUF 2 629 653 | 449 | 0 | 449 | 0,02 |
| | 01/2024 | 2 626 | ¥ 387 559 | 124 | 0 | 124 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 3 563 | KZT 1 657 857 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 01/2024 | 35 104 | MXN 609 593 | 733 | 0 | 733 | 0,03 |
| BOA | 01/2024 | 653 | MYR 3 030 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | 789 | NOK 8 386 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 11 495 | PLN 48 125 | 740 | 0 | 740 | 0,03 |
| | 01/2024 | 1 120 | TRY 33 068 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BOA | 02/2024 | CNY 17 120 | \$ 2 373 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | 02/2024 | DOP 311 118 | 5 381 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| BOA | 02/2024 | EGP 7 943 | 228 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT 239 796 | 495 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| BOA | 02/2024 | \$ 32 113 | CNY 226 960 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 02/2024 | 8 063 | EGP 279 769 | 0 | (480) | (480) | (0,02) |
| BOA | 02/2024 | 927 | KES 147 671 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | 11 245 | TRY 353 321 | 310 | 0 | 310 | 0,01 |
| BOA | 03/2024 | CNH 50 569 | \$ 6 978 | 0 | (164) | (164) | (0,01) |
| | 03/2024 | COP 16 699 329 | 4 303 | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| BOA | 03/2024 | DOP 14 158 | 247 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 03/2024 | MYR 116 846 | 24 720 | 0 | (900) | (900) | (0,03) |
| BOA | 03/2024 | \$ 24 720 | CNH 179 665 | 657 | 0 | 657 | 0,02 |
| | 03/2024 | 14 783 | IDR 235 463 987 | 486 | 0 | 486 | 0,02 |
| BOA | 03/2024 | 483 | INR 40 380 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 17 | PHP 947 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BOA | 04/2024 | MYR 54 906 | \$ 11 996 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ 11 970 | MYR 55 218 | 153 | 0 | 153 | 0,01 |
| BOA | 06/2024 | 2 167 | BRL 10 667 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 06/2024 | 625 | KES 104 721 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| BOA | 06/2024 | 3 069 | MXN 53 552 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2030 | 12 534 | IDR 246 110 438 | 1 275 | 0 | 1 275 | 0,04 |
| BPS | 01/2024 | BRL 41 740 | \$ 8 571 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | EGP 26 122 | 746 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 21 976 | 23 999 | 0 | (282) | (282) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 1 452 | 1 842 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | ¥ 2 277 500 | 16 064 | 0 | (127) | (127) | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN 3 662 | 983 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | PLN 65 363 | 14 864 | 0 | (1 754) | (1 754) | (0,06) |
| | 01/2024 | TRY 11 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | \$ 7 168 | AUD 10 699 | 134 | 0 | 134 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 148 | CAD 5 624 | 118 | 0 | 118 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 1 147 | EGP 37 804 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 399 | € 4 917 | 50 | (16) | 34 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 99 469 | HUF 34 908 407 | 1 129 | 0 | 1 129 | 0,04 |
| | 01/2024 | 58 128 | ¥ 8 205 000 | 109 | 0 | 109 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 6 215 | MXN 113 983 | 486 | 0 | 486 | 0,02 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|----------|--------|
| | 01/2024 | \$ | 18 756 | PLN | 79 225 | \$ 1 386 | \$ 0 | \$ 1 386 | 0,05 |
| | 01/2024 | ZAR | 1 865 846 | \$ | 100 648 | 0 | (1 245) | (1 245) | (0,04) |
| | 02/2024 | EGP | 44 730 | | 1 153 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT | 451 638 | | 953 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 164 941 | | 5 189 | 0 | (262) | (262) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ | 8 968 | CNY | 63 615 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP | 2 695 790 | \$ | 3 114 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 29 566 | | 4 079 | 0 | (97) | (97) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 382 188 319 | | 24 384 | 26 | (425) | (399) | (0,01) |
| | 03/2024 | THB | 127 731 | | 3 594 | 0 | (173) | (173) | (0,01) |
| | 03/2024 | TWD | 382 317 | | 12 291 | 0 | (357) | (357) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 68 521 | CNH | 496 297 | 1 578 | 0 | 1 578 | 0,05 |
| | 03/2024 | | 15 590 | IDR | 243 952 096 | 230 | (1) | 229 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 1 677 | INR | 140 257 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 10 757 | PEN | 40 195 | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| | 12/2024 | | 1 899 | EGP | 92 680 | 0 | (76) | (76) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | NZD | 12 038 | \$ | 7 406 | 0 | (216) | (216) | (0,01) |
| | 01/2024 | TRY | 1 119 | | 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 783 | HUF | 278 189 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 9 879 | MXN | 173 326 | 310 | 0 | 310 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 4 882 | MYR | 22 335 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 124 586 | PLN | 543 145 | 13 504 | 0 | 13 504 | 0,46 |
| | 01/2024 | | 23 233 | TRY | 689 977 | 5 | (55) | (50) | 0,00 |
| | 02/2024 | | 11 312 | RON | 51 773 | 176 | 0 | 176 | 0,01 |
| | 02/2024 | | 20 990 | TRY | 650 743 | 185 | (50) | 135 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 015 | RSD | 108 697 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 13 | THB | 452 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 18 797 | TRY | 590 201 | 61 | (78) | (17) | 0,00 |
| | 04/2024 | | 2 390 | | 77 029 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| BSH | 02/2024 | CLP | 4 347 403 | \$ | 4 901 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ | 5 620 000 | | 40 031 | 0 | (121) | (121) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL | 54 752 | | 11 245 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | CLP | 25 703 966 | | 29 474 | 98 | (54) | 44 | 0,00 |
| | 01/2024 | COP | 335 445 850 | | 83 950 | 235 | (2 715) | (2 480) | (0,09) |
| | 01/2024 | EGP | 29 698 | | 807 | 0 | (81) | (81) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 42 548 | | 123 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 2 217 900 | | 15 590 | 0 | (151) | (151) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN | 2 344 810 | | 128 939 | 0 | (8 905) | (8 905) | (0,31) |
| | 01/2024 | PLN | 45 336 | | 11 257 | 1 | (270) | (269) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 3 724 | AUD | 5 504 | 36 | (3) | 33 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 8 533 | BRL | 41 709 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 5 379 | CAD | 7 197 | 80 | 0 | 80 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 614 | CHF | 3 148 | 129 | 0 | 129 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 16 902 | CLP | 14 986 793 | 258 | 0 | 258 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 41 121 | COP | 161 929 065 | 678 | 0 | 678 | 0,02 |
| | 01/2024 | | 2 806 | € | 2 594 | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 447 | HUF | 156 759 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 15 819 | ¥ | 2 233 500 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 191 264 | MXN | 3 370 725 | 6 892 | 0 | 6 892 | 0,24 |
| | 01/2024 | | 190 | NOK | 2 028 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 6 923 | PEN | 25 750 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 8 561 | PLN | 36 980 | 841 | 0 | 841 | 0,03 |
| | 01/2024 | | 3 010 | ZAR | 56 761 | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 219 | ZMW | 30 108 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 593 400 | \$ | 32 183 | 0 | (222) | (222) | (0,01) |
| | 02/2024 | BRL | 41 709 | | 8 497 | 0 | (75) | (75) | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP | 227 732 | | 6 386 | 500 | 0 | 500 | 0,02 |
| | 02/2024 | RON | 72 699 | | 15 779 | 0 | (353) | (353) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ | 139 492 | BRL | 705 788 | 5 568 | 0 | 5 568 | 0,19 |
| | 02/2024 | | 26 678 | CNY | 190 332 | 233 | 0 | 233 | 0,01 |
| | 02/2024 | | 3 165 | EGP | 110 309 | 0 | (304) | (304) | (0,01) |
| | 02/2024 | | 5 396 | RON | 24 705 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 565 | UYU | 22 441 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 02/2024 | ZMW | 57 765 | \$ | 2 517 | 275 | 0 | 275 | 0,01 |
| | 03/2024 | CLP | 15 048 484 | | 16 902 | 0 | (262) | (262) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH | 74 212 | | 10 257 | 0 | (225) | (225) | (0,01) |
| | 03/2024 | EGP | 9 371 | | 266 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 86 157 354 | | 5 529 | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS | 1 754 | | 482 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | 920 000 | | 6 564 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 11 511 | | 3 044 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 80 112 | BRL | 395 801 | 878 | 0 | 878 | 0,03 |
| | 03/2024 | | 4 571 | EGP | 168 891 | 0 | (719) | (719) | (0,03) |
| | 03/2024 | | 8 960 | IDR | 138 429 735 | 18 | (2) | 16 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 30 513 | PEN | 113 429 | 90 | (41) | 49 | 0,00 |
| | 03/2024 | ZMW | 77 313 | \$ | 3 135 | 155 | 0 | 155 | 0,01 |
| | 04/2024 | \$ | 11 245 | BRL | 55 307 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 04/2024 | | 6 074 | EGP | 230 221 | 0 | (857) | (857) | (0,03) |
| | 04/2024 | | 2 417 | KES | 396 910 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 04/2024 | | 1 941 | TRY | 65 210 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 06/2024 | £ | 4 181 | \$ | 5 250 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ | 6 706 | BRL | 33 312 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 06/2024 | \$ 1 956 | KES 329 541 | \$ 31 | \$ 0 | \$ 31 | 0,00 |
| | 07/2024 | 2 819 | MXN 49 190 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10/2024 | 7 613 | COP 33 207 906 | 527 | 0 | 527 | 0,02 |
| | 12/2024 | 1 453 | EGP 70 419 | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | 01/2025 | 7 613 | COP 33 558 104 | 494 | 0 | 494 | 0,02 |
| | 04/2025 | 7 613 | 34 144 305 | 531 | 0 | 531 | 0,02 |
| | 10/2025 | 3 831 | 18 664 632 | 508 | 0 | 508 | 0,02 |
| DUB | 01/2024 | HUF 1 590 298 | \$ 4 281 | 0 | (302) | (302) | (0,01) |
| | 01/2024 | NGN 384 375 | 625 | 244 | 0 | 244 | 0,01 |
| | 01/2024 | PLN 3 186 | 797 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 332 | MXN 5 927 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | 611 | PLN 2 394 | 2 | (4) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | 129 | ZAR 2 458 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 184 | ZMW 29 553 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP 225 836 | \$ 6 512 | 391 | 0 | 391 | 0,01 |
| | 02/2024 | \$ 65 325 | BRL 320 413 | 529 | 0 | 529 | 0,02 |
| | 02/2024 | 8 173 | EGP 287 242 | 0 | (767) | (767) | (0,03) |
| | 02/2024 | 2 139 | ZMW 50 267 | 0 | (188) | (188) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH 19 140 | \$ 2 656 | 0 | (47) | (47) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 5 177 | CNH 37 439 | 111 | 0 | 111 | 0,00 |
| | 03/2024 | 28 169 | CZK 629 254 | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 462 | SGD 1 935 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 04/2024 | TRY 2 282 | \$ 73 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ 793 | KES 129 656 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2024 | € 20 306 | PLN 93 764 | 1 078 | 0 | 1 078 | 0,04 |
| | 10/2024 | \$ 1 118 | TRY 45 133 | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| | 11/2024 | ¥ 1 030 144 | \$ 7 297 | 0 | (337) | (337) | (0,01) |
| GLM | 01/2024 | AUD 6 553 | 4 394 | 0 | (79) | (79) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 17 030 | 12 532 | 0 | (385) | (385) | (0,01) |
| | 01/2024 | CHF 10 648 | 12 151 | 0 | (507) | (507) | (0,02) |
| | 01/2024 | COP 66 990 836 | 15 796 | 0 | (1 496) | (1 496) | (0,05) |
| | 01/2024 | DOP 2 163 811 | 37 841 | 746 | 0 | 746 | 0,03 |
| | 01/2024 | EGP 101 314 | 2 695 | 0 | (334) | (334) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 2 273 778 | 6 126 | 0 | (427) | (427) | (0,02) |
| | 01/2024 | MXN 2 410 262 | 137 587 | 2 | (4 108) | (4 106) | (0,14) |
| | 01/2024 | \$ 17 527 | COP 66 990 836 | 0 | (235) | (235) | (0,01) |
| | 01/2024 | 3 055 | EGP 100 557 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 01/2024 | 564 | HUF 196 745 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | 11 990 | MXN 208 993 | 296 | 0 | 296 | 0,01 |
| | 01/2024 | 12 927 | TRY 389 484 | 148 | 0 | 148 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR 160 293 | \$ 9 119 | 360 | 0 | 360 | 0,01 |
| | 02/2024 | DOP 963 461 | 16 744 | 212 | 0 | 212 | 0,01 |
| | 02/2024 | EGP 22 626 | 647 | 116 | 0 | 116 | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT 397 826 | 846 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 907 | EGP 32 747 | 0 | (137) | (137) | (0,01) |
| | 02/2024 | 3 627 | KZT 1 683 848 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 02/2024 | 4 038 | TRY 123 409 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 17 421 | \$ 2 414 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 03/2024 | DOP 1 515 719 | 26 498 | 563 | 0 | 563 | 0,02 |
| | 03/2024 | IDR 101 964 502 | 6 576 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 35 293 | CZK 787 923 | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| | 03/2024 | 704 | TRY 22 094 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | 3 557 | TWD 110 186 | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| | 04/2024 | DOP 143 308 | \$ 2 492 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| | 08/2024 | \$ 3 630 | COP 15 688 860 | 249 | 0 | 249 | 0,01 |
| | 10/2024 | 1 128 | TRY 45 402 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| | 11/2024 | 7 297 | ¥ 1 031 316 | 346 | 0 | 346 | 0,01 |
| | 11/2024 | 2 355 | TRY 96 033 | 109 | 0 | 109 | 0,00 |
| | 04/2025 | 15 796 | COP 72 164 026 | 1 417 | 0 | 1 417 | 0,05 |
| IND | 01/2024 | 42 058 | € 38 361 | 327 | 0 | 327 | 0,01 |
| | 01/2024 | 7 576 | ZAR 138 703 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 06/2024 | 7 206 | TWD 185 403 | 0 | (997) | (997) | (0,03) |
| JPM | 01/2024 | BRL 26 149 | \$ 5 417 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 01/2024 | EGP 65 662 | 1 817 | 0 | (141) | (141) | (0,01) |
| | 01/2024 | PLN 138 195 | 31 514 | 0 | (3 621) | (3 621) | (0,13) |
| | 01/2024 | \$ 5 440 | BRL 26 237 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 01/2024 | 499 | EGP 16 406 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 327 | HUF 1 521 537 | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| | 01/2024 | 30 744 | MXN 542 237 | 1 133 | 0 | 1 133 | 0,04 |
| | 01/2024 | 82 | NGN 67 814 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | 22 023 | PLN 92 010 | 1 370 | 0 | 1 370 | 0,05 |
| | 01/2024 | 18 170 | TRY 539 342 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 01/2024 | 531 | ZAR 10 213 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZMW 43 329 | \$ 1 888 | 206 | 0 | 206 | 0,01 |
| | 02/2024 | EGP 144 800 | 4 035 | 518 | 0 | 518 | 0,02 |
| | 02/2024 | KZT 178 766 | 379 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 491 | EGP 17 695 | 0 | (75) | (75) | 0,00 |
| | 02/2024 | 11 121 | INR 929 100 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 050 | TRY 93 092 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 03/2024 | AED 29 435 | \$ 8 021 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP 2 581 710 | 2 863 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 171 068 | 23 599 | 0 | (564) | (564) | (0,02) |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | CZK 272 835 | \$ 12 145 | \$ 0 | \$ (37) | \$ (37) | 0,00 |
| | 03/2024 | EGP 71 883 | | 133 | 0 | 133 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 61 095 991 | | 3 935 | 0 | (27) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 3 419 | CNH 24 285 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 03/2024 | 19 589 | IDR 304 089 389 | 130 | 0 | 130 | 0,00 |
| | 03/2024 | 503 | INR 42 039 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 10 556 | TWD 327 284 | 269 | 0 | 269 | 0,01 |
| | 04/2024 | KES 802 538 | \$ 5 222 | 282 | 0 | 282 | 0,01 |
| | 04/2024 | TRY 267 487 | | 350 | 0 | 350 | 0,01 |
| | 04/2024 | \$ 5 417 | BRL 26 412 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 04/2024 | 2 684 | KES 438 883 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 04/2024 | 2 330 | TRY 69 917 | 0 | (190) | (190) | (0,01) |
| | 06/2024 | 1 104 | IDR 16 560 000 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 06/2024 | 354 | KRW 458 914 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2024 | PLN 93 519 | € 20 306 | 0 | (1 016) | (1 016) | (0,04) |
| | 08/2024 | \$ 7 568 | COP 32 729 708 | 525 | 0 | 525 | 0,02 |
| | 09/2024 | € 4 640 | PLN 22 010 | 388 | 0 | 388 | 0,01 |
| | 09/2024 | PLN 10 106 | € 2 231 | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| | 12/2024 | \$ 2 519 | EGP 121 881 | 0 | (122) | (122) | 0,00 |
| | 03/2030 | IDR 252 540 875 | \$ 12 118 | 0 | (2 052) | (2 052) | (0,07) |
| | 03/2030 | \$ 11 598 | IDR 246 110 438 | 2 211 | 0 | 2 211 | 0,08 |
| MBC | 01/2024 | € 48 414 | \$ 52 644 | 0 | (849) | (849) | (0,03) |
| | 01/2024 | HUF 10 922 002 | | 0 | (1 921) | (1 921) | (0,07) |
| | 01/2024 | ¥ 8 557 500 | | 0 | (869) | (869) | (0,03) |
| | 01/2024 | PLN 18 619 | | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 191 | AUD 1 795 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 01/2024 | 992 | EGP 32 681 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 685 | € 1 540 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 869 | PLN 11 534 | 64 | 0 | 64 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 018 | ZAR 18 621 | 2 | (2) | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | CLP 1 131 755 | \$ 1 291 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY 113 835 | | 0 | (339) | (339) | (0,01) |
| | 02/2024 | ¥ 800 000 | | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 4 978 | CNY 35 262 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 02/2024 | 1 419 | EGP 54 891 | 10 | (129) | (119) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 266 788 | \$ 36 756 | 0 | (926) | (926) | (0,03) |
| | 03/2024 | PHP 162 297 | | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 9 023 | CNH 65 040 | 163 | 0 | 163 | 0,01 |
| | 03/2024 | 5 188 | IDR 81 983 796 | 129 | 0 | 129 | 0,00 |
| | 03/2024 | 3 114 | INR 259 463 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | NGN 317 955 | \$ 517 | 202 | 0 | 202 | 0,01 |
| | 01/2024 | PLN 9 685 | | 0 | (79) | (79) | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY 198 | | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 143 | EGP 105 605 | 0 | (102) | (102) | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 424 | € 3 121 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 586 | £ 2 850 | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| | 01/2024 | 162 | HUF 57 544 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 999 | ¥ 147 220 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 01/2024 | 138 | KZT 64 386 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 24 480 | MYR 114 235 | 448 | 0 | 448 | 0,02 |
| | 01/2024 | 3 035 | NZD 4 935 | 90 | 0 | 90 | 0,00 |
| | 01/2024 | 586 | PLN 2 391 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 01/2024 | 12 018 | ZAR 221 812 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP 21 106 | \$ 563 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT 585 717 | | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 61 942 | CNY 438 578 | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| | 02/2024 | 245 | EGP 8 859 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 02/2024 | 1 613 | KZT 746 819 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 11 751 | \$ 1 629 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 293 030 009 | | 0 | (593) | (593) | (0,02) |
| | 03/2024 | MXN 28 927 | | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 137 573 | | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 591 | EGP 21 199 | 0 | (104) | (104) | 0,00 |
| | 03/2024 | 18 305 | IDR 286 163 042 | 272 | (20) | 252 | 0,01 |
| | 06/2024 | £ 4 180 | \$ 5 249 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ 10 513 | £ 8 361 | 150 | 0 | 150 | 0,01 |
| | 06/2024 | 123 | KRW 159 802 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 06/2024 | 4 253 | MXN 74 208 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2024 | 2 812 | IDR 43 220 440 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| RBC | 01/2024 | 14 290 | MXN 245 146 | 121 | 0 | 121 | 0,00 |
| | 04/2024 | MXN 3 262 | \$ 184 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | AUD 6 545 | | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 313 | ZAR 5 748 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 938 | THB 67 324 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | € 106 | \$ 117 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 329 | BRL 41 020 | 116 | 0 | 116 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 039 | EGP 34 170 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | 88 | € 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 363 | MXN 94 168 | 173 | 0 | 173 | 0,01 |
| | 01/2024 | 55 777 | MYR 260 539 | 1 077 | 0 | 1 077 | 0,04 |
| | 01/2024 | 854 | NGN 701 988 | 0 | (159) | (159) | (0,01) |
| | 01/2024 | 2 797 | PEN 10 387 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 2 483 | TRY 73 526 | \$ 0 | \$ (6) | \$ (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 178 | ZMW 53 410 | 0 | (103) | (103) | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY 46 204 | \$ 6 398 | 0 | (135) | (135) | (0,01) |
| | 02/2024 | EGP 81 649 | 2 119 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 02/2024 | MYR 69 594 | 14 790 | 1 | (418) | (417) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ 117 | CNY 836 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 203 | EGP 112 637 | 0 | (367) | (367) | (0,01) |
| | 02/2024 | 804 | KES 128 238 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 971 | MYR 18 395 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 57 781 | \$ 7 981 | 0 | (180) | (180) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR 1 098 623 976 | 68 744 | 0 | (2 498) | (2 498) | (0,09) |
| | 03/2024 | TWD 147 714 | 4 745 | 0 | (143) | (143) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 2 643 | CNH 19 178 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 03/2024 | 407 | EGP 14 579 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| | 03/2024 | 236 | HKD 1 842 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 11 290 | IDR 175 269 112 | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 094 | INR 91 524 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 33 521 | THB 1 158 668 | 651 | 0 | 651 | 0,02 |
| | 06/2024 | KES 411 269 | \$ 2 677 | 197 | 0 | 197 | 0,01 |
| | 06/2024 | \$ 543 | KRW 704 915 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08/2024 | 3 425 | COP 14 823 400 | 240 | 0 | 240 | 0,01 |
| | 12/2024 | 2 119 | EGP 103 245 | 0 | (88) | (88) | 0,00 |
| | 03/2030 | IDR 239 680 000 | \$ 10 700 | 0 | (2 748) | (2 748) | (0,10) |
| SOG | 01/2024 | \$ 1 697 | EGP 55 237 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| | 01/2024 | 236 | MXN 4 330 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 01/2024 | 55 327 | PLN 222 066 | 1 132 | 0 | 1 132 | 0,04 |
| | 02/2024 | CNY 17 169 | \$ 2 378 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT 569 687 | 1 193 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 2 540 | CNY 18 244 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 02/2024 | 29 094 | RON 133 438 | 516 | 0 | 516 | 0,02 |
| | 03/2024 | CZK 362 124 | \$ 16 066 | 0 | (104) | (104) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 1 881 | CNH 13 655 | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | CLP 15 572 153 | \$ 17 615 | 0 | (203) | (203) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 4 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 775 | BRL 13 763 | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 105 043 447 | \$ 6 770 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 2 831 | COP 11 298 719 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 03/2024 | 3 225 | IDR 50 352 876 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | HUF 429 071 | \$ 1 152 | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 650 | ¥ 242 105 | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 12 946 | \$ 1 793 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | € 140 851 | 154 931 | 0 | (696) | (696) | (0,02) |
| | 01/2024 | £ 8 670 | 10 967 | 0 | (86) | (86) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 1 656 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 14 586 | 3 446 | 0 | (263) | (263) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 963 | AUD 1 451 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 01/2024 | 16 560 | HUF 6 089 292 | 988 | 0 | 988 | 0,03 |
| | 01/2024 | 22 209 | MXN 383 410 | 331 | 0 | 331 | 0,01 |
| | 01/2024 | 4 373 | NOK 46 649 | 221 | 0 | 221 | 0,01 |
| | 01/2024 | 4 155 | PLN 16 573 | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| | 01/2024 | 286 | SEK 2 956 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 217 | ZAR 61 394 | 136 | 0 | 136 | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ 3 850 000 | \$ 27 507 | 0 | (85) | (85) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 8 924 | CZK 198 655 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 04/2024 | 6 557 | TRY 198 196 | 0 | (492) | (492) | (0,02) |
| | | | | \$ 68 348 | \$ (59 233) | \$ 9 115 | 0,31 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 3 547 0,12

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| CERTIFICATS DE DÉPÔT | | | |
| Banco Davivienda S.A. | | | |
| 10,942 % éch. 28/04/2026 | | COP 1 270 000 | \$ 331 0,01 |
| 11,679 % éch. 12/05/2025 | | 17 176 800 | 4 412 0,15 |
| 12,950 % éch. 08/03/2026 | | 12 221 099 | 3 281 0,11 |
| 13,183 % éch. 06/06/2026 | | 10 745 000 | 2 922 0,10 |
| 13,455 % éch. 13/06/2025 | | 7 290 000 | 1 940 0,07 |
| 13,456 % éch. 07/06/2025 | | 14 592 000 | 3 883 0,13 |
| 13,456 % éch. 09/06/2025 | | 4 874 000 | 1 297 0,05 |
| 13,501 % éch. 13/12/2024 | | 12 258 000 | 3 233 0,11 |
| 15,389 % éch. 21/02/2024 | | 3 100 500 | 809 0,03 |
| Bancolombia S.A. | | | |
| 5,917 % éch. 27/01/2024 | | 14 430 300 | 3 725 0,13 |
| 10,388 % éch. 20/04/2026 | | 23 408 300 | 6 039 0,21 |
| 13,320 % éch. 08/06/2025 | | 6 362 000 | 1 672 0,06 |
| 13,456 % éch. 14/06/2025 | | 11 991 000 | 3 183 0,11 |
| 13,637 % éch. 14/12/2024 | | 17 049 000 | 4 464 0,16 |
| 16,137 % éch. 01/09/2024 | | 6 849 000 | 1 814 0,06 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-----|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| BBVA Colombia S.A. | COP | 6 344 000 | \$ 1 7 | 0,06 |
| 13,093 % éch. 28/04/2026 | | 2 726 000 | 746 | 0,03 |
| 13,229 % éch. 10/05/2026 | | 3 966 000 | 1 0 | 0,04 |
| 13,365 % éch. 04/05/2026 | | 6 028 200 | 1 5 | 0,05 |
| 14,460 % éch. 13/01/2024 | | 225 000 | 58 | 0,00 |
| 16,412 % éch. 25/04/2024 | | | | |
| Total des Certificats de dépôt | | | \$ 48 155 | 1,67 |
| Total des Investissements | | | \$ 3 126 143 | 108,51 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | \$ (245 202) | (8,51) |
| Actifs nets | | | \$ 2 880 941 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

- * Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre vendu avant l'émission.
- (c) Titre à rémunération en nature.
- (d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (e) Titre à coupon zéro.
- (f) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (g) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (h) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (i) Affilié au Fonds.
- (j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,76 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-----------------|------------------|------------------|------------------------|
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » | 10/06/2022 | \$ 41 | \$ 41 | 0,00 |
| Development Bank of Southern Africa 8,600 % éch. 21/10/2024 | 07/10/2021 | 14 861 | 12 064 | 0,42 |
| DrillCo Holding Lux S.A. | 08/06/2023 | 158 | 196 | 0,01 |
| Flourish Century 6,600 % éch. 04/02/2022 | 25/08/2021 | 2 759 | 256 | 0,01 |
| | | \$ 17 819 | \$ 12 557 | 0,44 |

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 294 989 \$ (31 décembre 2022 : 86 429 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 1 840 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 885 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 55 945 \$ (31 décembre 2022 : 21 557 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 12 200 \$ (31 décembre 2022 : 28 320 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 2 660 342 | \$ 183 284 | \$ 2 843 626 |
| Fonds d'investissement | 233 751 | 0 | 0 | 233 751 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 1 240 | (1 601) | 972 | 611 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 48 155 | 0 | 48 155 |
| Totaux | \$ 234 991 | \$ 2 706 896 | \$ 184 256 | \$ 3 126 143 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 695 287 | \$ 77 697 | \$ 1 772 984 |
| Fonds d'investissement | 131 643 | 0 | 0 | 131 643 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 739 | 1 315 | (11) | 2 043 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 3 012 | 4 042 | 7 054 |
| Totaux | \$ 132 382 | \$ 1 699 614 | \$ 81 728 | \$ 1 913 724 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 4,100 % | 19/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (31 948) | \$ (35 343) | (1,23) |
| | 5,540 | 27/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | \$ (4 861) | (4 865) | (0,17) |
| | 5,550 | 27/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (6 379) | (6 384) | (0,22) |
| | 5,700 | 27/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (1 851) | (1 853) | (0,06) |
| | 5,720 | 27/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (12 108) | (12 117) | (0,42) |
| | 5,740 | 27/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (3 509) | (3 512) | (0,12) |
| BRC | 6,000 | 11/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | PLN (156 122) | (39 737) | (1,38) |
| | 4,150 | 19/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (6 404) | (7 085) | (0,25) |
| | 5,450 | 27/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | \$ (1 938) | (1 940) | (0,07) |
| | 5,900 | 12/12/2022 | TBD ⁽¹⁾ | PLN (197 832) | (53 716) | (1,87) |
| | 5,900 | 16/03/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (91 297) | (24 401) | (0,85) |
| | 5,900 | 31/07/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (193 551) | (50 504) | (1,75) |
| JML | 5,900 | 11/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (15 022) | (3 820) | (0,13) |
| | 5,900 | 11/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (50 037) | (12 725) | (0,44) |
| | 4,750 | 27/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | \$ (6 380) | (6 409) | (0,22) |
| MBC | 11,300 | 08/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | PLN (66 276) | (16 938) | (0,59) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (281 349) | (9,77) |

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 46 | \$ 0 | \$ 46 | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | (2 401) | (1 960) | (4 361) | 13 050 | (12 520) | 530 |
| BPS | 382 | (1 630) | (1 248) | (16 890) | 15 580 | (1 310) |
| BRC | 13 436 | (14 670) | (1 234) | (1 554) | 1 440 | (114) |
| BSH | (528) | 470 | (58) | (1 101) | 0 | (1 101) |
| BSS | S/O | S/O | S/O | 0 | 920 | 920 |
| CBK | (671) | (4 000) | (4 671) | 6 571 | (6 325) | 246 |
| CKL | S/O | S/O | S/O | (265) | 0 | (265) |
| CLY | S/O | S/O | S/O | 2 606 | 0 | 2 606 |
| DUB | 1 073 | (1 610) | (537) | 50 | 0 | 50 |
| FAR | (58) | 0 | (58) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 2 281 | (2 840) | (559) | 10 551 | (10 070) | 481 |
| GST | 587 | (490) | 97 | (180) | 190 | 10 |
| HUS | S/O | S/O | S/O | 6 780 | (6 910) | (130) |
| IND | (673) | 500 | (173) | (834) | (1 510) | (2 344) |
| JPM | 100 | 0 | 100 | 1 710 | (1 280) | 430 |
| MBC | (4 769) | 5 390 | 621 | 5 248 | (4 930) | 318 |
| MYC | (128) | 310 | 182 | (365) | 410 | 45 |
| MYI | (1 841) | 560 | (1 281) | (4 865) | 3 730 | (1 135) |
| RBC | 116 | 0 | 116 | (4 253) | 4 420 | 167 |
| RYL | (19) | 0 | (19) | 274 | (260) | 14 |
| SCX | (4 266) | 4 300 | 34 | 1 418 | (1 120) | 298 |
| SOG | 942 | (1 390) | (448) | (587) | 590 | 3 |
| SSB | (106) | (280) | (386) | (924) | 1 040 | 116 |
| TOR | (51) | 180 | 129 | 309 | (270) | 39 |
| UAG | 95 | 490 | 585 | 4 355 | (4 700) | (345) |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 80,36 | 63,67 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 14,63 | 27,35 |
| Autres valeurs mobilières | 3,72 | 1,33 |
| Fonds d'investissement | 8,11 | 6,86 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,04 | 0,04 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,14) | (1,03) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,12 | 1,10 |
| Certificats de dépôt | 1,67 | 0,37 |
| Contrats de prise en pension | (9,77) | (4,45) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Argentine | 0,00 | 0,16 |
| Azerbaïdjan | 0,10 | 0,23 |
| Bahamas | S/O | 0,13 |
| Bésil | 2,30 | 4,48 |
| Îles Caïmans | 0,74 | 0,44 |
| Chili | 3,98 | 2,06 |
| Chine | 5,25 | 5,74 |
| Colombie | 3,74 | 3,65 |
| République tchèque | 4,32 | 2,89 |
| Danemark | 0,00 | 0,00 |
| République dominicaine | 3,34 | 1,30 |
| Équateur | 0,35 | S/O |
| Égypte | 0,22 | S/O |
| Hongrie | 1,52 | 0,40 |
| Indonésie | 9,03 | 5,26 |
| Internationales | 0,38 | S/O |
| Irlande | 0,60 | 0,83 |
| Israël | 1,14 | 1,75 |
| Côte d'Ivoire | 0,21 | 0,38 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,24 | 0,51 |
| Kazakhstan | S/O | 0,05 |
| Luxembourg | 0,02 | 0,01 |
| Malaisie | 8,07 | 9,11 |
| Mexique | 7,94 | 8,11 |
| Pays-Bas | S/O | 0,20 |
| Nigeria | S/O | 0,22 |
| Pérou | 1,88 | 2,32 |
| Philippines | 0,10 | 0,04 |
| Pologne | 7,51 | 4,79 |
| Qatar | 0,62 | 0,92 |
| Roumanie | 2,78 | 3,99 |
| Russie | 0,16 | 0,26 |
| Serbie | 0,11 | 0,15 |
| Afrique du Sud | 12,85 | 13,70 |
| Corée du Sud | S/O | 0,18 |
| Supranationales | 0,57 | 0,37 |
| Tanzanie | 0,93 | 0,49 |
| Thaïlande | 8,35 | 4,23 |
| Turquie | 0,76 | 0,53 |
| Ukraine | 0,14 | S/O |
| Émirats arabes unis | 1,10 | 1,60 |
| Royaume-Uni | 0,22 | 0,58 |
| États-Unis | 1,82 | 2,50 |
| Uruguay | 0,38 | S/O |
| Îles Vierges britanniques | S/O | 0,31 |
| Zambie | 0,16 | S/O |
| Instruments à court terme | 4,78 | 7,48 |
| Fonds d'investissement | 8,11 | 6,86 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,04 | 0,04 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,08) | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,06) | (1,03) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Options de change | 0,08 | 0,13 |
| Options vendues | | |
| Options de change | (0,48) | (0,01) |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,01) | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,00 | S/O |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03 | (0,14) |
| Swaps sur devises croisées | 0,21 | 0,42 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,02) | 0,19 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Swaps de volatilité | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | 0,31 | 0,52 |
| Certificats de dépôt | 1,67 | 0,37 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (8,51) | 0,31 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | | | | | | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|--|----------------------------------|------------------------------|--|---|---|------------------------------|--|-----------|--|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------|---------|-------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | CHILI | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | | | |
| Bonos de la Tesorería de la República en Pesos | | | | 4,750 % éch. 24/11/2032 HUF 2 000 \$ 5 0,00 | | | | 1,750 % éch. 25/04/2032 PLN 1 250 \$247 0,24 | | | | | | | | | | | | | |
| 2,300 % éch. 01/10/2028 | CLP | 200 000 | \$ 200 | 0,19 | 6,125 % éch. 22/05/2028 | \$ | 200 | 208 | 0,20 | 2,500 % éch. | | | | | | | | | | | |
| 2,800 % éch. 01/10/2033 | | 45 000 | 41 | 0,04 | 6,750 % éch. 22/10/2028 | HUF | 22 800 | 68 | 0,07 | 25/07/2026 (d) | 2 800 | 671 | 0,66 | | | | | | | | |
| 3,400 % éch. 01/10/2039 | | 312 710 | 405 | 0,40 | Total Hongrie | | | 2 404 | 2,35 | 2,500 % éch. 25/07/2027 | 3 190 | 750 | 0,73 | | | | | | | | |
| 4,700 % éch. 01/09/2030 | | 35 000 | 39 | 0,04 | INDONÉSIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | | |
| 5,000 % éch. 01/10/2028 | | 1 145 000 | 1 295 | 1,26 | Obligation internationale du gouvernement indonésien | | | | Obligation internationale du gouvernement roumain | | | | | | | | | | | | |
| 5,300 % éch. 01/11/2037 | | 160 000 | 181 | 0,18 | 6,375 % éch. 15/08/2028 | IDR | 11 778 000 | 764 | 0,74 | 4,150 % éch. 26/01/2028 | RON | 4 100 | 847 | 0,83 | | | | | | | |
| 5,800 % éch. 01/10/2034 | | 480 000 | 567 | 0,55 | 6,375 % éch. 15/04/2032 | | 19 987 000 | 1 286 | 1,25 | 4,150 % éch. 24/10/2030 | | 2 800 | 553 | 0,54 | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 01/04/2033 | | 1 325 000 | 1 596 | 1,56 | 6,375 % éch. 15/04/2042 | | 7 704 000 | 491 | 0,48 | 4,250 % éch. 28/04/2036 | | 5 965 | 1 099 | 1,07 | | | | | | | |
| 7,000 % éch. 01/05/2034 | | 20 000 | 26 | 0,03 | 6,500 % éch. 15/02/2031 | | 493 000 | 32 | 0,03 | 4,750 % éch. 11/10/2034 | | 1 340 | 263 | 0,26 | | | | | | | |
| Total Chili | | | | 4 350 | 4,25 | 7,000 % éch. 15/09/2030 | | 6 136 000 | 408 | 0,40 | 4,850 % éch. 22/04/2026 | | 4 400 | 952 | 0,93 | | | | | | |
| COLOMBIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Total Pologne | | | | 7 275 | 7,10 | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement colombien | | | | 1,000 % éch. 18/09/2030 COP 97 900 23 0,02 | | | | ROUMANIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | |
| 1,000 % éch. 26/03/2031 | | 204 600 | 46 | 0,05 | 1,000 % éch. 30/06/2032 | | 61 000 | 13 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement roumain | | | | | | | | | | | |
| 8,000 % éch. 14/11/2035 | \$ | 200 | 219 | 0,22 | 8,000 % éch. 14/11/2035 | \$ | 200 | 219 | 0,22 | 4,150 % éch. 26/01/2028 | RON | 4 100 | 847 | 0,83 | | | | | | | |
| TES colombien | | | | 7,000 % éch. 26/03/2031 COP 16 410 400 3 670 3,58 | | | | 1,250 % éch. 09/02/2033 | | | | | 2 259 100 | 695 | 0,68 | 4,150 % éch. 24/10/2030 | | 2 800 | 553 | 0,54 | |
| Total Colombie | | | | 4 666 | 4,56 | Total Roumanie | | | | 3 714 | 3,63 | AFRIQUE DU SUD | | | | | | | | | |
| RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque | | | | 0,050 % éch. 29/11/2029 CZK 45 100 1 634 1,60 | | | | 2,000 % éch. | | | | 31/01/2025 (c) ZAR 8 763 469 0,46 | | | | | | | | | |
| 0,250 % éch. 10/02/2027 | | 1 300 | 52 | 0,05 | 0,950 % éch. 15/05/2030 | | 30 600 | 1 158 | 1,13 | 6,250 % éch. 31/03/2036 | | 7 100 | 255 | 0,25 | 6,250 % éch. 31/03/2036 | ZAR | 7 100 | 255 | 0,25 | | |
| 1,200 % éch. 13/03/2031 | | 1 200 | 45 | 0,04 | 1,200 % éch. 13/03/2031 | | 1 200 | 45 | 0,04 | 7,000 % éch. 28/02/2031 | | 14 500 | 664 | 0,65 | 7,000 % éch. 28/02/2031 | | 14 500 | 664 | 0,65 | | |
| 1,500 % éch. 24/04/2040 | | 400 | 13 | 0,01 | 1,500 % éch. 24/04/2040 | | 400 | 13 | 0,01 | 8,000 % éch. | | 77 600 | 3 906 | 3,82 | 8,000 % éch. | | 77 600 | 3 906 | 3,82 | | |
| 1,750 % éch. 23/06/2032 | | 20 300 | 782 | 0,76 | 1,750 % éch. 23/06/2032 | | 20 300 | 782 | 0,76 | 8,250 % éch. | | 16 800 | 803 | 0,78 | 8,250 % éch. | | 16 800 | 803 | 0,78 | | |
| 1,950 % éch. 30/07/2033 | | 200 | 7 | 0,01 | 1,950 % éch. 30/07/2033 | | 200 | 7 | 0,01 | 8,500 % éch. 31/01/2037 | | 33 200 | 1 417 | 1,37 | 8,500 % éch. 31/01/2037 | | 33 200 | 1 417 | 1,37 | | |
| 2,000 % éch. 13/10/2037 | | 20 300 | 782 | 0,76 | 2,000 % éch. 13/10/2037 | | 20 300 | 782 | 0,76 | 8,750 % éch. 31/01/2044 | | 21 500 | 872 | 0,85 | 8,750 % éch. 31/01/2044 | | 21 500 | 872 | 0,85 | | |
| 2,400 % éch. 17/09/2025 | | 4 800 | 208 | 0,20 | 2,400 % éch. 17/09/2025 | | 4 800 | 208 | 0,20 | 8,750 % éch. 28/02/2048 | | 3 900 | 157 | 0,15 | 8,750 % éch. 28/02/2048 | | 3 900 | 157 | 0,15 | | |
| 2,500 % éch. 25/08/2028 | | 10 300 | 437 | 0,43 | 2,500 % éch. 25/08/2028 | | 10 300 | 437 | 0,43 | 8,875 % éch. 28/02/2035 | | 6 200 | 286 | 0,28 | 8,875 % éch. 28/02/2035 | | 6 200 | 286 | 0,28 | | |
| 4,200 % éch. 04/12/2036 | | 5 600 | 261 | 0,26 | 4,200 % éch. 04/12/2036 | | 5 600 | 261 | 0,26 | 9,000 % éch. 31/01/2040 | | 20 400 | 870 | 0,85 | 9,000 % éch. 31/01/2040 | | 20 400 | 870 | 0,85 | | |
| 4,900 % éch. 14/04/2034 | | 1 100 | 54 | 0,05 | 4,900 % éch. 14/04/2034 | | 1 100 | 54 | 0,05 | 10,500 % éch. | | 35 100 | 2 009 | 1,96 | 10,500 % éch. | | 35 100 | 2 009 | 1,96 | | |
| 5,000 % éch. 30/09/2030 | | 25 100 | 1 208 | 1,18 | 5,000 % éch. 30/09/2030 | | 25 100 | 1 208 | 1,18 | 21/12/2026 (d) | | 35 100 | 2 009 | 1,96 | 21/12/2026 (d) | | 35 100 | 2 009 | 1,96 | | |
| Total République tchèque | | | | 6 641 | 6,48 | Total Afrique du Sud | | | | 11 708 | 11,42 | SUPRANATIONALES | | | | | | | | | |
| RÉPUBLIQUE DOMINICAINE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | |
| Billets de la Banque centrale de République dominicaine | | | | 12,000 % éch. 03/10/2025 DOP 900 16 0,02 | | | | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | | | | 0,625 % éch. 25/07/2025 PLN 500 117 0,12 | | | | | | | | | |
| 13,000 % éch. 05/12/2025 | | 47 400 | 856 | 0,84 | 13,000 % éch. 05/12/2025 | | 47 400 | 856 | 0,84 | 5,800 % éch. 19/01/2028 | ZAR | 2 500 | 124 | 0,12 | 5,800 % éch. 19/01/2028 | ZAR | 2 500 | 124 | 0,12 | | |
| 13,000 % éch. 30/01/2026 | | 19 600 | 355 | 0,35 | 13,000 % éch. 30/01/2026 | | 19 600 | 355 | 0,35 | Total Allemagne | | | | 241 | 0,24 | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | | | | 11,250 % éch. 15/09/2035 54 700 1 019 0,99 | | | | Total République dominicaine | | | | 3 421 | 3,34 | HONGRIE | | | | | | | |
| 13,625 % éch. 03/02/2033 | | 45 500 | 956 | 0,93 | 13,625 % éch. 03/02/2033 | | 45 500 | 956 | 0,93 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Obligation internationale du gouvernement hongrois | | | | | | | |
| 13,625 % éch. 10/02/2034 | | 10 500 | 219 | 0,21 | 13,625 % éch. 10/02/2034 | | 10 500 | 219 | 0,21 | 4,000 % éch. 28/04/2051 | HUF | 205 700 | 415 | 0,41 | 4,000 % éch. 28/04/2051 | HUF | 205 700 | 415 | 0,41 | | |
| Total République dominicaine | | | | 3 421 | 3,34 | Total Équateur | | | | 120 | 0,12 | 4,500 % éch. 27/05/2032 | | 647 900 | 1 708 | 1,67 | 4,500 % éch. 27/05/2032 | | 647 900 | 1 708 | 1,67 |
| ÉQUATEUR | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ALLEMAGNE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement d'Équateur | | | | 3,500 % éch. 31/07/2035 \$ 7 3 0,00 | | | | 0,625 % éch. 25/07/2025 PLN 500 117 0,12 | | | | 5,800 % éch. 19/01/2028 ZAR 2 500 124 0,12 | | | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 31/07/2030 | | 250 | 117 | 0,12 | 6,000 % éch. 31/07/2030 | | 250 | 117 | 0,12 | Total Allemagne | | | | 241 | 0,24 | | | | | | |
| Total Équateur | | | | 120 | 0,12 | EXEMPLES | | | | EXEMPLES | | | | EXEMPLES | | | | | | | |
| ALLEMAGNE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | PÉROU | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | | | | 0,625 % éch. 25/07/2025 PLN 500 117 0,12 | | | | Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | | 5,350 % éch. 12/08/2040 PEN 200 46 0,04 | | | | | | | | | |
| 5,800 % éch. 19/01/2028 | ZAR | 2 500 | 124 | 0,12 | 5,800 % éch. 19/01/2028 | ZAR | 2 500 | 124 | 0,12 | 6,900 % éch. 12/08/2037 | | 900 | 245 | 0,24 | 6,900 % éch. 12/08/2037 | | 900 | 245 | 0,24 | | |
| Total Allemagne | | | | 241 | 0,24 | Total Pérou | | | | 1 977 | 1,93 | POLOGNE | | | | | | | | | |
| HONGRIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | EXEMPLES | | | | EXEMPLES | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois | | | | 4,000 % éch. 28/04/2051 HUF 205 700 415 0,41 | | | | 1,250 % éch. 25/10/2030 PLN 159 32 0,03 | | | | 1,250 % éch. 25/10/2030 PLN 159 32 0,03 | | | | | | | | | |
| 4,500 % éch. 27/05/2032 | | 647 900 | 1 708 | 1,67 | 4,500 % éch. 27/05/2032 | | 647 900 | 1 708 | 1,67 | Total Pologne | | | | 7 275 | 7,10 | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 3,450 % éch. 17/06/2043 | THB 30 013 | \$ 922 | 0,90 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| 3,775 % éch. 25/06/2032 | 2 667 | 85 | 0,08 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | |
| 4,260 % éch. 12/12/2037 | 1 710 | 56 | 0,06 | 10,900 % éch. | | | |
| Total Thaïlande | | 8 168 | 7,98 | 04/01/2024 (a)(b) | HUF 693 000 | \$ 2 001 | 1,96 |
| TURQUIE | | | | BONS DU TRÉSOR MALAISIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 3,289 % éch. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement turc | | | | 06/02/2024 (a)(b) | MYR 160 | 35 | 0,03 |
| 26,200 % éch. 05/10/2033 | TRY 300 | 11 | 0,01 | BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| URUGUAY | | | | 2,070 % éch. | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 23/01/2024 (a)(b) | \$ 1 700 | 1 695 | 1,66 |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen | | | | Total des Instruments à court terme | | 3 731 | 3,65 |
| 3,700 % éch. 26/06/2037 (c) | UYU 6 276 | 165 | 0,16 | Total des Valeurs mobilières | | | |
| 3,875 % éch. 02/07/2040 (c) | 5 672 | 153 | 0,15 | | \$ 83 869 | 81,89 | |
| 8,500 % éch. 15/03/2028 | 3 200 | 79 | 0,08 | | | | |
| Total Uruguay | | 397 | 0,39 | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net | |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--|------------------|--|--|---------------------|--------------|
| BPS | 5,450 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 15 600 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % échéance 15/02/2044 | \$ (15 987) | \$ 15 600 | \$ 15 609 | 15,23 | |
| Total Contrats de mise en pension | | | | | | | \$ (15 987) | \$ 15 600 | \$ 15 609 | 15,23 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 9 | \$ 17 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 1 | (1) | 0,00 |
| | | | | \$ 16 | 0,02 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 16 | 0,02 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 % | 20/03/2029 | £ 5 900 | \$ 109 | 0,10 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,232 | 05/10/2025 | ¥ 1 490 000 | (22) | (0,02) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,350 | 21/03/2026 | 1 575 000 | (21) | (0,02) |
| À payer | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 20/03/2026 | THB 12 560 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 20/03/2029 | 48 200 | (6) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | \$ 60 | 3 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 25 | (1) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 1 350 | 21 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 200 | (9) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 2 700 | 11 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 100 | 6 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,808 | 02/01/2026 | BRL 18 000 | 10 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,076 | 04/01/2027 | 1 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,083 | 02/01/2026 | 110 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,386 | 02/01/2029 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,512 | 04/01/2027 | 60 300 | 91 | 0,09 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,529 | 02/01/2026 | 300 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,602 | 04/01/2027 | 900 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,691 | 02/01/2026 | 1 100 | 3 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,751 | 02/01/2026 | 5 800 | 6 | 0,01 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,768 | 04/01/2027 | 200 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,811 | 02/01/2025 | 1 310 | 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,872 % | 04/01/2027 | BRL 500 | \$ (2) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,064 | 04/01/2027 | 400 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,169 | 04/01/2027 | 520 | 6 | 0,01 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,540 | 02/01/2024 | 2 700 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,040 | 01/04/2024 | 3 700 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,260 | 01/04/2024 | 3 200 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,350 | 01/07/2024 | 900 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,490 | 01/07/2024 | 900 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,595 | 01/07/2024 | 900 | 1 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,080 | 01/07/2024 | 1 800 | 3 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,800 | 02/01/2024 | 3 400 | 4 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,995 | 02/01/2024 | 900 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,705 | 26/03/2031 | COP 906 800 | (5) | (0,01) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,715 | 18/09/2030 | 83 500 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,800 | 30/06/2032 | 44 500 | 0 | 0,00 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,190 | 13/06/2029 | 180 300 | 1 | 0,00 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,305 | 28/04/2028 | 39 570 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,950 | 24/03/2030 | 81 280 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,300 | 26/03/2031 | 122 840 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,370 | 17/03/2030 | 47 800 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,393 | 21/03/2030 | 53 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,410 | 26/03/2031 | 123 400 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,423 | 17/03/2030 | 100 800 | (2) | 0,00 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,500 | 19/10/2033 | 220 600 | 6 | 0,01 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,930 | 07/03/2033 | 34 420 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,680 | 22/11/2025 | ZAR 600 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,070 | 30/11/2028 | 3 500 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,120 | 13/03/2028 | 300 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,140 | 16/11/2028 | 1 000 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,210 | 21/12/2026 | 700 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,225 | 31/08/2028 | 400 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 10/11/2028 | 700 | (1) | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,650 | 31/10/2028 | 200 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,735 | 31/01/2030 | 300 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,820 | 31/01/2030 | 37 370 | (6) | (0,01) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,455 | 31/01/2030 | 800 | 2 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 10,150 | 18/05/2033 | 300 | 1 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,390 | 30/12/2028 | AUD 220 | 3 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2028 | 12 470 | 121 | 0,12 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,030 | 20/03/2033 | CLP 5 340 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,230 | 17/11/2033 | 2 480 700 | (28) | (0,03) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,260 | 17/11/2028 | 8 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,310 | 16/11/2028 | 5 600 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,320 | 16/11/2028 | 736 100 | (12) | (0,01) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,400 | 16/11/2033 | 13 100 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,631 | 23/08/2028 | 15 700 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,690 | 01/09/2030 | 1 800 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,770 | 21/11/2027 | 28 300 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,780 | 03/10/2028 | 14 200 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,790 | 06/10/2033 | 15 000 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,855 | 05/10/2033 | 33 000 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,870 | 11/10/2033 | 14 200 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,920 | 02/10/2028 | 18 000 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,940 | 20/10/2033 | 6 100 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,990 | 20/10/2033 | 60 410 | (6) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,000 | 02/10/2028 | 35 000 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,070 | 28/02/2028 | 55 800 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,146 | 30/10/2032 | 97 000 | (10) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,235 | 26/10/2033 | 25 300 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | € 100 | (2) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 900 | (4) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 2 080 | 36 | 0,03 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 1 700 | 9 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 100 | 8 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,329 | 27/10/2033 | 100 | 7 | 0,01 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 10,570 | 22/08/2027 | HUF 4 800 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,710 | 25/05/2027 | PLN 600 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,735 | 09/10/2028 | 200 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,740 | 25/10/2033 | 100 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,910 | 25/07/2027 | 170 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,295 | 25/01/2028 | 15 750 | (95) | (0,09) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,830 | 19/08/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,890 | 22/08/2024 | 300 | (1) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,900 | 21/05/2027 | MXN 1 300 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,994 | 03/09/2026 | 1 490 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 9,055 | 03/09/2026 | 300 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 9,620 | 21/09/2033 | 1 300 | 4 | 0,00 |
| | | | | | \$ 214 | 0,21 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 214 | 0,21 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| JPM | Option de vente - EUR contre PLN hors cote | PLN 4,400 | 22/08/2024 | 9 | \$ 2 | \$ 5 | 0,01 |
| MYI | Option de vente - GBP contre USD hors cote | \$ 1,160 | 12/06/2024 | 3 681 | 15 | 8 | 0,01 |
| SCX | Option d'achat - USD contre JPY hors cote | ¥ 167,000 | 05/11/2024 | 28 | 1 | 1 | (0,01) |
| | | | | | \$ 18 | \$ 14 | 0,01 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 17,449 | 26/06/2024 | 100 | \$ (3) | \$ (3) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 100 | (3) | (3) | (0,01) |
| CBK | Option d'achat - USD contre BRL hors cote | BRL 4,968 | 20/06/2024 | 100 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre BRL hors cote | 4,968 | 20/06/2024 | 100 | (4) | (4) | (0,01) |
| GLM | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | TRY 40,250 | 30/10/2024 | 10 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,250 | 30/10/2024 | 10 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 39,800 | 31/10/2024 | 5 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 39,800 | 31/10/2024 | 5 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 40,930 | 07/11/2024 | 5 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,930 | 07/11/2024 | 5 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 41,150 | 07/11/2024 | 5 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 41,150 | 07/11/2024 | 5 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 41,160 | 11/11/2024 | 5 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 41,160 | 11/11/2024 | 5 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 04/03/2024 | 21 | 0 | (1) | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - USD contre IDR hors cote | IDR 14 950,000 | 06/06/2024 | 21 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre IDR hors cote | 14 950,000 | 06/06/2024 | 21 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 01/03/2024 | 58 | (1) | (2) | 0,00 |
| MYI | Option d'achat - USD contre IDR hors cote | IDR 15 370,000 | 13/08/2024 | 45 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre IDR hors cote | 15 370,000 | 13/08/2024 | 45 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 19,500 | 07/03/2024 | 67 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 50 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 50 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | \$ (31) | \$ (29) | (0,03) |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 % | 16/01/2024 | 300 | \$ (1) | \$ (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,01 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 1 800 | (4) | (6) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 1 800 | (4) | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 800 | (3) | (6) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 800 | (3) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (18) | \$ (17) | (0,01) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS SUR DEVICES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|---|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,048 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/06/2025 | \$ 10 000 | PHP 552 500 | \$ 10 | \$ (29) | \$ (19) | (0,02) |
| GLM | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,053 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 123 | 6 830 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,054 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 13 | 730 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 10 | \$ (30) | \$ (20) | (0,02) |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/03/2029 | MYR 80 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| GST | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/03/2029 | 410 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 1 | \$ (1) | \$ 0 | 0,00 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BOA | 01/2024 | CLP | 9 581 | \$ 11 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | COP | 160 986 | 42 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | DOP | 458 | 8 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 558 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | KZT | 4 244 | 9 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD | 38 | 23 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 53 | COP 213 294 | 2 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 24 | HUF 8 682 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 79 | MXN 1 380 | 2 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 34 | PLN 142 | 2 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 950 | TRY 28 188 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 02/2024 | DOP | 289 | \$ 5 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP | 66 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 535 | EGP 20 357 | 0 | (7) | (0,01) |
| | 02/2024 | | 10 | KES 1 593 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 45 | TRY 1 414 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | DOP | 172 | \$ 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 156 603 | 10 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 41 | COP 160 986 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 525 | IDR 8 171 901 | 5 | 5 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 6 | INR 490 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | | 18 | MXN 314 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | COP | 819 443 | \$ 207 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 280 | 306 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 381 022 | 1 087 | 0 | (14) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN | 499 | 28 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR | 433 | 93 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN | 141 | 32 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 369 | AUD 555 | 10 | 10 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 9 386 | BRL 46 145 | 113 | 113 | 0,11 |
| | 01/2024 | | 131 | CAD 177 | 4 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 72 | € 66 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 306 | HUF 106 647 | 3 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 011 | ¥ 284 300 | 7 | 7 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 9 | NZD 14 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 47 | PLN 199 | 3 | 3 | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP | 2 031 | \$ 52 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT | 1 173 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 3 | EGP 105 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 13 | TWD 399 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 1 067 922 | \$ 68 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 900 | 29 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 44 | IDR 685 495 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 20 | INR 1 703 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 209 | THB 7 221 | 4 | 4 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 135 | TWD 4 094 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 12/2024 | | 52 | EGP 2 554 | 0 | (2) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | PLN | 118 | \$ 28 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 839 | HUF 1 009 066 | 69 | 69 | 0,07 |
| | 01/2024 | | 536 | MYR 2 474 | 4 | 4 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 107 | RON 488 | 2 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 51 | TRY 1 591 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 | THB 18 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 105 | TRY 3 288 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 04/2024 | | 42 | 1 349 | 0 | (1) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | AUD | 118 | \$ 78 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL | 49 261 | 10 117 | 0 | (24) | (0,02) |
| | 01/2024 | CAD | 516 | 380 | 0 | (11) | (0,01) |
| | 01/2024 | CLP | 33 844 | 39 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | COP | 655 579 | 164 | 1 | (7) | (0,01) |
| | 01/2024 | € | 104 | 113 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 78 300 | 550 | 0 | (5) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN | 11 495 | 655 | 0 | (21) | (0,02) |
| | 01/2024 | PLN | 518 | 128 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 177 | CAD 237 | 3 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 49 | CLP 43 499 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 363 | COP 1 422 714 | 6 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 12 | HUF 4 300 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 533 | ¥ 75 300 | 1 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 554 | MXN 9 781 | 21 | 21 | 0,02 |
| | 01/2024 | | 3 | NOK 32 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 233 | PLN 924 | 2 | 2 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 01/2024 | ZAR | 67 089 | \$ 3 545 | \$ 0 | \$ (119) | \$ (119) | (0,12) |
| | 02/2024 | EGP | 2 792 | 74 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 438 | BRL 2 247 | 24 | 0 | 24 | 0,02 |
| | 02/2024 | | 43 | EGP 1 513 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 02/2024 | | 7 | UYU 278 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP | 43 678 | \$ 49 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | COP | 1 687 333 | 425 | 1 | (5) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | EGP | 106 | 3 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS | 28 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 12 | EGP 455 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 179 | IDR 2 755 379 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 532 | PEN 1 986 | 4 | (1) | 3 | 0,00 |
| | 04/2024 | | 10 117 | BRL 49 760 | 42 | 0 | 42 | 0,04 |
| | 04/2024 | | 19 | EGP 716 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 06/2024 | £ | 141 | \$ 176 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ | 13 | BRL 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2024 | | 24 | COP 104 688 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 12/2024 | | 66 | EGP 3 197 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2025 | | 24 | COP 105 792 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 04/2025 | | 24 | 107 640 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 10/2025 | | 12 | 58 464 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CHF | 211 | \$ 242 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 01/2024 | COP | 216 291 | 51 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | DOP | 76 905 | 1 346 | 28 | 0 | 28 | 0,03 |
| | 01/2024 | EGP | 761 | 20 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 62 | 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 5 032 | 14 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 352 | 20 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 57 | COP 216 291 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 10 | EGP 329 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 972 | MXN 34 501 | 56 | 0 | 56 | 0,06 |
| | 01/2024 | | 429 | ZAR 8 022 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR | 599 | \$ 34 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | DOP | 47 881 | 838 | 17 | 0 | 17 | 0,02 |
| | 02/2024 | EGP | 842 | 24 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT | 4 061 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 10 | BRL 52 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 9 | EGP 318 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | | 15 | KZT 6 963 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 268 | RON 1 221 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | UYU | 2 346 | \$ 59 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | DOP | 16 252 | 284 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | 03/2024 | \$ | 25 | TRY 792 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 10 | TWD 310 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | DOP | 44 281 | \$ 770 | 15 | 0 | 15 | 0,02 |
| | 08/2024 | \$ | 10 | COP 43 220 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2024 | | 3 | TRY 121 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2024 | | 8 | 316 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2025 | | 51 | COP 232 994 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | BRL | 1 890 | \$ 388 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | EGP | 147 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 290 882 | 829 | 0 | (11) | (11) | (0,01) |
| | 01/2024 | PLN | 591 | 135 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 121 | BRL 590 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 42 | HUF 15 179 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 111 | MXN 1 920 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 53 | PLN 222 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 838 | TRY 84 207 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 02/2024 | KZT | 511 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 75 | BRL 370 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 21 | EGP 739 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | | 720 | RON 3 319 | 16 | 0 | 16 | 0,02 |
| | 02/2024 | | 122 | TRY 3 731 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP | 156 003 | \$ 173 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB | 4 301 | 121 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 267 | BRL 1 310 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 57 | IDR 894 383 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 6 | INR 510 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 952 | SGD 1 263 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 292 | THB 10 379 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 112 | TWD 3 489 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 04/2024 | TRY | 533 | \$ 17 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ | 121 | BRL 596 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 06/2024 | | 3 | IDR 45 000 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2024 | € | 60 | PLN 277 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2024 | PLN | 276 | € 60 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2024 | \$ | 22 | COP 95 145 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2024 | € | 14 | PLN 66 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2024 | PLN | 30 | € 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | CAD | 51 | \$ 38 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 125 | 136 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 280 500 | 1 962 | 0 | (29) | (29) | (0,03) |

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| | 01/2024 | PLN | 68 | \$ 17 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 9 | AUD 13 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 4 | EGP 125 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 5 | € 5 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 66 | HUF 24 304 | 4 | 4 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 916 | PLN 7 707 | 44 | 44 | 0,04 | |
| | 02/2024 | | 0 | EGP 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | PHP | 1 053 | \$ 19 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 146 | IDR 2 304 219 | 3 | 3 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 118 | INR 9 832 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 31 | TRY 975 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 9 | TWD 289 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | EGP | 21 | \$ 1 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 142 | 156 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 2 | 3 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 24 565 | 70 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | PLN | 188 | 47 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 9 | CHF 8 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 11 | EGP 356 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 9 | KZT 4 238 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 10 199 | MYR 47 601 | 189 | 0 | 0,18 | |
| | 01/2024 | | 228 | PLN 903 | 1 | 1 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 164 | RON 739 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 337 | ZAR 6 199 | 2 | 2 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 9 494 | \$ 509 | 2 | (11) | (0,01) | |
| | 02/2024 | EGP | 157 | 4 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | KZT | 1 675 | 4 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 5 | KZT 2 315 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 105 147 387 | \$ 6 764 | 0 | (55) | (0,05) | |
| | 03/2024 | MXN | 86 | 5 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | THB | 4 552 | 133 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 182 | CZK 4 086 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 | EGP 51 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 13 | IDR 202 419 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 2 170 | TWD 67 409 | 64 | 64 | 0,06 | |
| | 06/2024 | £ | 141 | \$ 176 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 06/2024 | \$ | 353 | £ 281 | 5 | 5 | 0,01 | |
| | 06/2024 | | 9 | MXN 157 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 08/2024 | | 8 | IDR 122 960 | 0 | 0 | 0,00 | |
| RYL | 01/2024 | NZD | 219 | \$ 135 | 0 | (4) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 226 | NOK 2 455 | 16 | 16 | 0,02 | |
| | 03/2024 | | 8 177 | IDR 126 868 150 | 50 | 50 | 0,05 | |
| SCX | 01/2024 | MXN | 3 486 | \$ 201 | 0 | (4) | 0,00 | |
| | 01/2024 | MYR | 21 801 | 4 669 | 0 | (89) | (0,09) | |
| | 01/2024 | \$ | 278 | BRL 1 369 | 4 | 4 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 0 | EGP 7 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 121 | ¥ 17 400 | 2 | 2 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 83 | SEK 865 | 3 | 3 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 14 | ZMW 346 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 02/2024 | EGP | 3 023 | \$ 79 | 2 | 2 | 0,00 | |
| | 02/2024 | MYR | 159 | 33 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 8 | KES 1 276 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 7 095 783 | \$ 456 | 0 | (4) | 0,00 | |
| | 03/2024 | THB | 18 872 | 545 | 0 | (12) | (0,01) | |
| | 03/2024 | TWD | 18 928 | 611 | 0 | (16) | (0,02) | |
| | 03/2024 | \$ | 1 | EGP 51 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 8 | IDR 130 805 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 13 | INR 1 111 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 392 | THB 48 126 | 27 | 27 | 0,03 | |
| | 03/2024 | | 17 | TWD 548 | 1 | 1 | 0,00 | |
| | 08/2024 | | 9 | COP 38 952 | 1 | 1 | 0,00 | |
| | 12/2024 | | 66 | EGP 3 242 | 0 | (3) | 0,00 | |
| SSB | 01/2024 | CLP | 1 704 803 | \$ 1 928 | 0 | (22) | (0,02) | |
| | 01/2024 | £ | 80 | 101 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 146 | CLP 126 862 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 109 | COP 435 027 | 2 | 2 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 493 | INR 41 221 | 1 | 1 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | € | 3 591 | \$ 3 877 | 0 | (92) | (0,09) | |
| | 01/2024 | £ | 14 | 18 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | PLN | 46 | 11 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 620 | BRL 3 049 | 8 | 8 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 24 | HUF 8 810 | 1 | 1 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 90 | MXN 1 592 | 4 | 4 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 13 | NOK 143 | 1 | 1 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 52 | ZAR 954 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 000 | CZK 22 256 | 0 | (6) | (0,01) | |
| | 04/2024 | | 18 | TRY 544 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | | | | | \$ 991 | \$ (705) | \$ 286 | 0,28 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ 234 | 0,23 | |

| DESCRIPTION | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-----|--|----|----------------------------------|---------------------------|
| CERTIFICATS DE DÉPÔT | | | | | |
| Banco Davivienda S.A. | | | | | |
| 11,679 % éch. 12/05/2025 | COP | 47 700 | \$ | 12 | 0,01 |
| 12,950 % éch. 08/03/2026 | | 34 677 | | 9 | 0,01 |
| 13,183 % éch. 06/06/2026 | | 30 000 | | 8 | 0,01 |
| 13,455 % éch. 13/06/2025 | | 20 000 | | 5 | 0,01 |
| 13,456 % éch. 07/06/2025 | | 41 000 | | 11 | 0,01 |
| 13,456 % éch. 09/06/2025 | | 14 000 | | 4 | 0,00 |
| 13,501 % éch. 13/12/2024 | | 33 000 | | 9 | 0,01 |
| 15,389 % éch. 21/02/2024 | | 9 500 | | 3 | 0,00 |
| Bancolombia S.A. | | | | | |
| 5,917 % éch. 27/01/2024 | | 46 200 | | 12 | 0,01 |
| 10,388 % éch. 20/04/2026 | | 65 000 | | 16 | 0,02 |
| 13,320 % éch. 08/06/2025 | | 17 000 | | 4 | 0,00 |
| 13,456 % éch. 14/06/2025 | | 33 000 | | 9 | 0,01 |
| 13,637 % éch. 14/12/2024 | | 47 000 | | 12 | 0,01 |
| 16,137 % éch. 01/09/2024 | | 18 000 | | 5 | 0,01 |
| BBVA Colombia S.A. | | | | | |
| 13,093 % éch. 28/04/2026 | | 18 000 | | 5 | 0,01 |
| 13,229 % éch. 10/05/2026 | | 7 000 | | 2 | 0,00 |
| 13,365 % éch. 04/05/2026 | | 11 000 | | 3 | 0,00 |
| 14,460 % éch. 13/01/2024 | | 18 800 | | 5 | 0,00 |
| Total des Certificats de dépôt | | | \$ | 134 | 0,13 |
| Total des Investissements | | | \$ | 100 067 | 97,71 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | \$ | 2 341 | 2,29 |
| Actifs nets | | | \$ | 102 408 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Des titres d'une juste valeur globale de 8 738 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 388 \$ (31 décembre 2022 : 39 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements | | | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|-----------|----------------|--|---|----------------|
| | identiques (Niveau 1) | | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ | 83 869 | \$ 0 | \$ | 83 869 |
| Contrats de mise en pension | 0 | | 15 600 | 0 | | 15 600 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 17 | | 447 | 0 | | 464 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | | 134 | 0 | | 134 |
| Totaux | \$ 17 | \$ | 100 050 | \$ 0 | \$ | 100 067 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements | | | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|-----------|--------------|--|---|--------------|
| | identiques (Niveau 1) | | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ | 6 270 | \$ 0 | \$ | 6 270 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | | 54 | 0 | | 54 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | | 0 | 4 | | 4 |
| Totaux | \$ 0 | \$ | 6 324 | \$ 4 | \$ | 6 328 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 6,100 % | 31/07/2023 | À définir ⁽¹⁾ | PLN (206) | \$ (54) | (0,05) |
| | 6,100 | 09/08/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 050) | (273) | (0,27) |
| | 9,000 | 31/07/2023 | À définir ⁽¹⁾ | ZAR (1 425) | (81) | (0,08) |
| | 9,000 | 02/10/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 004) | (57) | (0,05) |
| | 9,000 | 16/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (4 649) | (257) | (0,25) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (722) | (0,70) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ (23) | \$ 0 | \$ (23) | \$ 3 | \$ 0 | \$ 3 |
| BPS | 111 | 0 | 111 | S/O | S/O | S/O |
| BRC | 70 | 0 | 70 | 33 | 0 | 33 |
| CBK | (110) | 0 | (110) | 26 | 0 | 26 |
| GLM | 115 | (70) | 45 | 30 | 0 | 30 |
| GST | (6) | 0 | (6) | S/O | S/O | S/O |
| MBC | 19 | 0 | 19 | S/O | S/O | S/O |
| MYI | 192 | 0 | 192 | (2) | 0 | (2) |
| RYL | 62 | 0 | 62 | S/O | S/O | S/O |
| SCX | (89) | 0 | (89) | (35) | 0 | (35) |
| SSB | (21) | 0 | (21) | S/O | S/O | S/O |
| UAG | (86) | 0 | (86) | S/O | S/O | S/O |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû/de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 73,55 | 69,10 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 7,67 | 24,21 |
| Autres valeurs mobilières | 0,67 | 1,57 |
| Contrats de mise en pension | 15,23 | S/O |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,02 | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,21 | (0,02) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,23 | 0,83 |
| Certificats de dépôt | 0,13 | 0,06 |
| Contrats de prise en pension | (0,70) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Chili | 4,25 | 2,02 |
| Colombie | 4,56 | 3,54 |
| République tchèque | 6,48 | 6,84 |
| République dominicaine | 3,34 | 0,23 |
| Équateur | 0,12 | S/O |
| Allemagne | 0,24 | 1,45 |
| Hongrie | 2,35 | 2,17 |
| Indonésie | 7,61 | 5,33 |
| Israël | S/O | 2,52 |
| Malaisie | 5,92 | 8,58 |
| Mexique | 8,02 | 5,26 |
| Pérou | 1,93 | 2,20 |
| Pologne | 7,10 | 2,47 |
| Roumanie | 3,63 | 4,38 |
| Afrique du Sud | 11,42 | 10,65 |
| Supranationales | 2,89 | 14,91 |
| Thaïlande | 7,98 | 4,28 |
| Turquie | 0,01 | S/O |
| Uruguay | 0,39 | 1,12 |
| Instruments à court terme | 3,65 | 16,93 |
| Contrats de mise en pension | 15,23 | S/O |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,02 | S/O |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,21 | (0,02) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Options de change | 0,01 | 0,09 |
| Options vendues | | |
| Options de change | (0,03) | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,01) | S/O |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | (0,09) |
| Swaps sur devises croisées | (0,02) | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,00 | S/O |
| Swaps de volatilité | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | 0,28 | 0,83 |
| Certificats de dépôt | 0,13 | 0,06 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 2,29 | 4,25 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | ANGOLA | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement angolais | | | | 4,875 % éch. 13/05/2036 | | | | New Metro Global Ltd. | | | |
| 8,000 % éch. 26/11/2029 | \$ 9 700 | \$ 8 643 | 0,22 | Total Bulgarie | € 5 200 | \$ 6 168 | 0,16 | 4,500 % éch. 02/05/2026 | \$ 2 600 | \$ 657 | 0,02 |
| 8,250 % éch. 09/05/2028 | 11 200 | 10 353 | 0,27 | | | | | Poinsettia Finance Ltd. | 11 679 | 9 919 | 0,26 |
| 8,750 % éch. 14/04/2032 | 300 | 265 | 0,01 | CAMEROUN | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 9,125 % éch. 26/11/2049 | 10 000 | 8 187 | 0,21 | Obligation internationale du gouvernement de la République du Cameroun | | | | Seazen Group Ltd. | | | |
| 9,375 % éch. 08/05/2048 | 7 000 | 5 843 | 0,15 | 5,950 % éch. 07/07/2032 | | | | 4,450 % éch. 13/07/2025 | | | |
| 9,500 % éch. 12/11/2025 | 6 100 | 6 003 | 0,16 | 9,500 % éch. 19/11/2025 | | | | \$ 1 478 | | | |
| Total Angola | | 39 294 | 1,02 | Total Cameroun | | | | 11 177 | | | |
| ARGENTINE | | | | CANADA | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Frontiera Energy Corp. | | | | 7,875 % éch. 21/06/2028 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement argentin | | | | 6,732 % éch. 30/04/2031 | | | | 1 877 | | | |
| 0,750 % éch. 09/07/2030 | 18 162 | 7 296 | 0,19 | ÎLES CAÏMANS | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| 1,000 % éch. 09/07/2029 | 11 837 | 4 726 | 0,12 | Betony CLO Ltd. | | | | 6,732 % éch. 30/04/2031 | | | |
| 3,500 % éch. 09/07/2041 | 54 655 | 18 671 | 0,48 | CIFC Funding Ltd. | | | | 6,657 % éch. 18/04/2031 | | | |
| 3,625 % éch. 09/07/2035 | 59 367 | 20 245 | 0,53 | Dryden CLO Ltd. | | | | 6,775 % éch. 15/01/2031 | | | |
| 4,250 % éch. 09/01/2038 | 43 156 | 17 156 | 0,45 | Dryden Senior Loan Fund | | | | 6,852 % éch. 15/08/2030 | | | |
| Provincia de Buenos Aires | | | | Golub Capital Partners CLO 26B Ltd. | | | | 6,697 % éch. 20/04/2031 | | | |
| 6,375 % éch. 01/09/2037 | 5 000 | 1 927 | 0,05 | KKR CLO Ltd. | | | | 6,655 % éch. 15/04/2031 | | | |
| Provincia de Cordoba | | | | 6,785 % éch. 16/10/2030 | | | | 1 357 | | | |
| 6,875 % éch. 10/12/2025 | 1 527 | 1 390 | 0,04 | Northwoods Capital Ltd. | | | | 7,246 % éch. 15/06/2031 | | | |
| Provincia de la Rioja | | | | Voya CLO Ltd. | | | | 6,608 % éch. 19/04/2031 | | | |
| 6,500 % éch. 24/02/2028 | 6 321 | 3 666 | 0,09 | Wind River CLO Ltd. | | | | 6,707 % éch. 18/07/2031 | | | |
| Provincia de Neuquen | | | | | | | | 11 207 | | | |
| 6,750 % éch. 27/04/2030 | 2 210 | 1 901 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | | Sunac China Holdings Ltd. | | | |
| Total Argentine | | 76 978 | 2,00 | 1,000 % éch. 30/09/2032 | | | | 880 | | | |
| AZERBAÏDJAN | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement azerbaïdjanais | | | | AAC Technologies Holdings, Inc. | | | | 2,825 % éch. 02/06/2026 | | | |
| 4,750 % éch. 18/03/2024 | 3 239 | 3 227 | 0,08 | Bioceanico Sovereign Certificate Ltd. | | | | 0,000 % éch. 05/06/2034 (c) | | | |
| Total Azerbaïdjan | | 42 795 | 1,11 | Country Garden Holdings Co. Ltd. | | | | 2,700 % éch. 12/07/2026 ^ | | | |
| BAHREÏN | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni | | | | 2,700 % éch. 22/10/2025 ^ | | | | 3,125 % éch. 22/10/2025 ^ | | | |
| 4,250 % éch. 25/01/2028 | 11 300 | 10 685 | 0,28 | 5,400 % éch. 27/05/2025 ^ | | | | 1 300 | | | |
| 5,625 % éch. 30/09/2031 | 700 | 660 | 0,01 | 6,150 % éch. 17/09/2025 ^ | | | | 900 | | | |
| Total Bahreïn | | 11 345 | 0,29 | Gaci First Investment Co. | | | | 4,875 % éch. 14/02/2035 | | | |
| BRÉSIL | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banco do Brasil S.A. | | | | 5,000 % éch. 13/10/2027 (j) | | | | 5,125 % éch. 14/02/2053 | | | |
| 3,250 % éch. 30/09/2026 | 2 700 | 2 565 | 0,07 | ICD Funding Ltd. | | | | 3,223 % éch. 28/04/2026 | | | |
| 8,500 % éch. 29/07/2026 | MXN 294 000 | 16 337 | 0,43 | Interoceanica Finance Ltd. | | | | 0,000 % éch. 30/11/2025 (c) | | | |
| Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais | | | | 0,000 % éch. 15/05/2030 (c) | | | | 7,860 % éch. 15/05/2030 | | | |
| 5,333 % éch. 15/02/2028 | \$ 25 095 | 24 727 | 0,64 | Kaisa Group Holdings Ltd. | | | | 8,500 % éch. 30/06/2022 ^ | | | |
| CSN Inova Ventures | | | | 8,375 % éch. 30/06/2024 ^ | | | | 9,375 % éch. 30/06/2024 ^ | | | |
| 6,750 % éch. 28/01/2028 | 15 800 | 15 450 | 0,40 | 9,750 % éch. 28/09/2023 ^ | | | | 11,250 % éch. 09/04/2022 ^ | | | |
| Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. | | | | 11,500 % éch. 30/01/2023 ^ | | | | 11,700 % éch. 11/11/2025 ^ | | | |
| 0,000 % éch. 29/01/2024 | | | | 11,950 % éch. 12/11/2023 ^ | | | | 2 600 | | | |
| (c)(f) | 14 563 | 500 | 0,01 | KSA Sukuk Ltd. | | | | 5,268 % éch. 25/10/2028 | | | |
| Vale S.A. | | | | Lima Metro Line Finance Ltd. | | | | 4,350 % éch. 05/04/2036 | | | |
| 0,000 % (f) | BRL 188 860 | 13 773 | 0,36 | 5,875 % éch. 05/07/2034 | | | | 1 004 | | | |
| | | 73 352 | 1,91 | | | | | 12 300 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | Yango Justice International Ltd. | | | | 7,500 % éch. 15/04/2024 ^ | | | |
| 4,750 % éch. 14/01/2050 | \$ 4 700 | 3 631 | 0,09 | Total Chine | | | | 1 014 | | | |
| Total Brésil | | 76 983 | 2,00 | | | | | 0,03 | | | |
| BULGARIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare | | | | | | | | | | | |
| 4,375 % éch. 13/05/2031 | € 3 800 | 4 419 | 0,11 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banco Davivienda S.A. | | | |
| 6,650 % éch. 22/04/2031 (f)(h) | \$ 900 | \$ 645 | 0,02 |
| Ecopetrol S.A. | | | |
| 4,625 % éch. 02/11/2031 | 9 800 | 8 324 | 0,22 |
| 5,375 % éch. 26/06/2026 | 2 200 | 2 159 | 0,05 |
| 5,875 % éch. 28/05/2045 | 3 100 | 2 452 | 0,06 |
| 6,875 % éch. 29/04/2030 | 200 | 198 | 0,01 |
| 7,375 % éch. 18/09/2043 | 2 400 | 2 294 | 0,06 |
| | | 16 072 | 0,42 |

| | | | |
|---|--------|--------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement colombien | | | |
| 3,125 % éch. 15/04/2031 | 15 507 | 12 663 | 0,33 |
| 3,875 % éch. 15/02/2061 (j) | 13 000 | 8 130 | 0,21 |
| 4,125 % éch. 15/05/2051 | 13 700 | 9 151 | 0,24 |
| 4,500 % éch. 28/01/2026 | 7 900 | 7 790 | 0,20 |
| 4,500 % éch. 15/03/2029 | 400 | 376 | 0,01 |
| 5,000 % éch. 15/06/2045 | 3 400 | 2 650 | 0,07 |
| 5,200 % éch. 15/05/2049 | 12 700 | 9 963 | 0,26 |
| 5,625 % éch. 26/02/2044 | 4 800 | 4 051 | 0,10 |
| 7,375 % éch. 18/09/2037 | 1 400 | 1 458 | 0,04 |
| 7,500 % éch. 02/02/2034 | 5 800 | 6 136 | 0,16 |
| 8,000 % éch. 14/11/2035 | 4 300 | 4 713 | 0,12 |
| 8,750 % éch. 14/11/2053 | 3 600 | 4 148 | 0,11 |
| | | 71 229 | 1,85 |

| | | | |
|----------------|--|--------|------|
| Total Colombie | | 87 301 | 2,27 |
|----------------|--|--------|------|

| | | | |
|---|-------|-------|------|
| COSTA RICA | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain | | | |
| 5,625 % éch. 30/04/2043 | 3 000 | 2 765 | 0,07 |
| 7,300 % éch. 31/11/2054 | 6 300 | 6 851 | 0,18 |
| Total Costa Rica | | 9 616 | 0,25 |

| | | | |
|---|----------|---------|------|
| RÉPUBLIQUE DOMINICAINE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Billets de la Banque centrale de République dominicaine | | | |
| 12,000 % éch. 03/10/2025 DOP | 48 600 | 854 | 0,02 |
| 13,000 % éch. 05/12/2025 | 787 600 | 14 226 | 0,37 |
| 13,000 % éch. 30/01/2026 | 350 100 | 6 340 | 0,16 |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | | | |
| 4,875 % éch. 23/09/2032 | \$ 6 200 | 5 660 | 0,15 |
| 5,300 % éch. 21/01/2041 | 7 700 | 6 679 | 0,17 |
| 5,600 % éch. 27/01/2025 | 9 600 | 9 564 | 0,25 |
| 5,500 % éch. 22/02/2029 | 17 500 | 17 150 | 0,45 |
| 5,875 % éch. 30/01/2060 | 7 650 | 6 636 | 0,17 |
| 5,950 % éch. 25/01/2027 | 16 600 | 16 697 | 0,43 |
| 6,000 % éch. 19/07/2028 | 12 400 | 12 450 | 0,32 |
| 6,000 % éch. 22/02/2033 | 10 800 | 10 679 | 0,28 |
| 6,400 % éch. 05/06/2049 | 250 | 236 | 0,01 |
| 6,875 % éch. 29/01/2026 | 8 600 | 8 775 | 0,23 |
| 7,450 % éch. 30/04/2044 | 100 | 106 | 0,00 |
| 9,750 % éch. 05/06/2026 DOP | 207 150 | 3 572 | 0,09 |
| 11,250 % éch. 15/09/2035 | 320 900 | 5 981 | 0,16 |
| 13,625 % éch. 03/02/2033 | 420 200 | 8 829 | 0,23 |
| 13,625 % éch. 10/02/2034 | 326 900 | 6 811 | 0,18 |
| Total République dominicaine | | 141 245 | 3,67 |

| | | | |
|--|--------|--------|------|
| ÉQUATEUR | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Ecuador Social Bond SARL | | | |
| 0,000 % éch. 30/01/2035 (c) | \$ 622 | 472 | 0,01 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement d'Équateur | | | |
| 0,000 % éch. 31/07/2030 (c) | 5 432 | 1 567 | 0,04 |
| 2,500 % éch. 31/07/2040 | 23 343 | 7 470 | 0,20 |
| 3,500 % éch. 31/07/2035 | 33 551 | 12 062 | 0,31 |
| 6,000 % éch. 31/07/2030 | 44 006 | 20 595 | 0,54 |
| | | 41 694 | 1,09 |
| Total Équateur | | 42 166 | 1,10 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ÉGYPTE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien | | | |
| 4,750 % éch. 11/04/2025 | € 2 452 | \$ 2 473 | 0,07 |
| 5,250 % éch. 06/10/2025 (j) | \$ 6 000 | 5 471 | 0,14 |
| 5,625 % éch. 16/04/2030 | € 1 670 | 1 183 | 0,03 |
| 5,750 % éch. 29/05/2024 (j) | \$ 800 | 784 | 0,02 |
| 6,375 % éch. 11/04/2031 | € 20 000 | 14 262 | 0,37 |
| 6,875 % éch. 30/04/2040 | \$ 5 100 | 3 097 | 0,08 |
| 7,053 % éch. 15/01/2032 | 6 100 | 4 197 | 0,11 |
| 7,300 % éch. 30/09/2033 | 16 200 | 10 742 | 0,28 |
| 7,500 % éch. 16/02/2061 | 6 500 | 3 817 | 0,10 |
| 7,625 % éch. 29/05/2032 | 11 800 | 8 231 | 0,21 |
| 7,903 % éch. 21/02/2048 | 22 000 | 13 328 | 0,35 |
| 8,150 % éch. 20/11/2059 | 2 100 | 1 296 | 0,03 |
| 8,500 % éch. 31/01/2047 | 10 300 | 6 437 | 0,17 |
| 8,750 % éch. 30/09/2051 | 2 000 | 1 270 | 0,03 |
| 8,875 % éch. 29/05/2050 | 12 300 | 7 873 | 0,21 |
| Total Égypte | | 84 461 | 2,20 |

| | | | |
|---|--------|--------|------|
| SALVADOR | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement salvadorien | | | |
| 6,375 % éch. 18/01/2027 | 1 100 | 976 | 0,03 |
| 7,125 % éch. 20/01/2050 | 12 707 | 9 048 | 0,24 |
| 7,625 % éch. 21/09/2034 | 3 800 | 2 829 | 0,07 |
| 7,625 % éch. 01/02/2041 | 530 | 400 | 0,01 |
| 8,250 % éch. 10/04/2032 | 2 610 | 2 222 | 0,06 |
| 8,625 % éch. 28/02/2029 | 185 | 166 | 0,00 |
| 9,500 % éch. 15/07/2052 | 1 400 | 1 173 | 0,03 |
| Total Salvador | | 16 814 | 0,44 |

| | | | |
|--|-----|-----|------|
| GABON | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement gabonais | | | |
| 6,375 % éch. 12/12/2024 | 540 | 520 | 0,01 |
| 6,625 % éch. 06/02/2031 | 400 | 335 | 0,01 |
| Total Gabon | | 855 | 0,02 |

| | | | |
|--------------------------------------|-----|-----|------|
| GÉORGIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Georgian Railway JSC | | | |
| 4,000 % éch. 17/06/2028 | 300 | 277 | 0,01 |

| | | | |
|--|--------|--------|------|
| GHANA | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement du Ghana | | | |
| 6,375 % éch. 11/02/2027 ^ | 11 100 | 4 985 | 0,13 |
| 7,625 % éch. 16/05/2029 ^ | 800 | 351 | 0,01 |
| 7,750 % éch. 07/04/2029 ^ | 6 800 | 2 990 | 0,08 |
| 7,875 % éch. 11/02/2035 ^ | 4 029 | 1 774 | 0,05 |
| 8,125 % éch. 26/03/2032 ^ | 6 100 | 2 698 | 0,07 |
| 8,625 % éch. 07/04/2034 ^ | 12 600 | 5 533 | 0,14 |
| 8,750 % éch. 11/03/2061 ^ | 1 750 | 760 | 0,02 |
| 8,875 % éch. 07/05/2042 ^ | 1 600 | 691 | 0,02 |
| 8,950 % éch. 26/03/2051 ^ | 4 600 | 1 998 | 0,05 |
| Total Ghana | | 21 780 | 0,57 |

| | | | |
|--|-------|--------|------|
| GUATEMALA | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement du Guatemala | | | |
| 4,375 % éch. 05/06/2027 | 8 200 | 7 884 | 0,20 |
| 4,500 % éch. 03/05/2026 | 6 900 | 6 716 | 0,17 |
| 4,650 % éch. 07/10/2041 | 800 | 656 | 0,02 |
| 4,875 % éch. 13/02/2028 | 7 120 | 6 948 | 0,18 |
| 5,375 % éch. 24/04/2032 | 300 | 291 | 0,01 |
| 6,600 % éch. 13/06/2036 | 7 400 | 7 640 | 0,20 |
| Total Guatemala | | 30 135 | 0,78 |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|-------|------|
| HONG KONG | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| AIA Group Ltd. | | | |
| 3,200 % éch. 16/09/2040 | 900 | 684 | 0,02 |
| Fortune Star BVI Ltd. | | | |
| 3,950 % éch. 02/10/2026 | € 3 000 | 2 118 | 0,06 |
| 5,000 % éch. 18/05/2026 | \$ 200 | 147 | 0,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,050 % éch. 27/01/2027 | \$ 1 300 | \$ 861 | 0,02 |
| 6,850 % éch. 02/07/2024 | 2 200 | 2 131 | 0,06 |
| Huarong Finance Co. Ltd. | | | |
| 3,875 % éch. 13/11/2029 | 300 | 255 | 0,01 |
| 4,500 % éch. 29/05/2029 | 3 650 | 3 237 | 0,08 |
| 5,000 % éch. 19/11/2025 | 3 700 | 3 574 | 0,09 |
| 5,500 % éch. 16/01/2025 | 200 | 198 | 0,01 |
| | | 13 205 | 0,35 |

| | | | |
|--|---------|--------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Airport Authority Hong Kong | | | |
| 2,100 % éch. 08/03/2026 (f) | 7 500 | 7 009 | 0,18 |
| 2,625 % éch. 04/02/2051 | 1 000 | 693 | 0,02 |
| 4,875 % éch. 12/01/2030 | 9 100 | 9 259 | 0,24 |
| Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong | | | |
| 3,750 % éch. 07/06/2032 | € 7 700 | 8 902 | 0,23 |
| | | 25 863 | 0,67 |
| Total Hong Kong | | 39 068 | 1,02 |

| | | | |
|--------------------------------------|----------|-------|------|
| HONGRIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| MVM Energetika Zrt | | | |
| 7,500 % éch. 09/06/2028 | \$ 5 600 | 5 859 | 0,15 |

| | | | |
|--|----------|--------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Banque de développement hongroise | | | |
| 6,500 % éch. 29/06/2028 | 15 300 | 15 778 | 0,41 |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois | | | |
| 3,125 % éch. 21/09/2051 | 2 500 | 1 703 | 0,04 |
| 5,250 % éch. 16/06/2029 | 8 400 | 8 463 | 0,22 |
| 5,500 % éch. 16/06/2034 | 700 | 713 | 0,02 |
| 6,125 % éch. 22/05/2028 | 4 300 | 4 478 | 0,12 |
| 6,250 % éch. 22/09/2032 | 7 000 | 7 486 | 0,19 |
| 6,750 % éch. 25/09/2052 | 3 500 | 3 925 | 0,10 |
| 7,625 % éch. 29/03/2041 | 5 000 | 5 991 | 0,16 |
| Magyar Export-Import Bank | | | |
| 6,000 % éch. 16/05/2029 | € 8 400 | 9 871 | 0,26 |
| 6,125 % éch. 04/12/2027 | \$ 5 500 | 5 604 | 0,15 |
| | | 64 012 | 1,67 |
| Total Hongrie | | 69 871 | 1,82 |

| | | | |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| INDE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| NTPC Ltd. | | | |
| 3,750 % éch. 03/04/2024 | 2 000 | 1 991 | 0,05 |
| Reliance Industries Ltd. | | | |
| 2,875 % éch. 12/01/2032 | 2 400 | 2 058 | 0,06 |
| | | 4 049 | 0,11 |

| | | | |
|------------------------------|-------|-------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Export-Import Bank of India | | | |
| 3,375 % éch. 05/08/2026 | 600 | 577 | 0,01 |
| 3,875 % éch. 12/03/2024 | 4 100 | 4 087 | 0,11 |
| | | 4 664 | 0,12 |
| Total Inde | | 8 713 | 0,23 |

| | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|------|
| INDONÉSIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Indonesia Asahan Aluminium PT | | | |
| 5,450 % éch. 15/05/2030 | 8 000 | 8 080 | 0,21 |
| 5,800 % éch. 15/05/2050 | 3 000 | 2 918 | 0,08 |
| LLPL Capital Pte. Ltd. | | | |
| 6,875 % éch. 04/02/2039 | 885 | 854 | 0,02 |
| Pelabuhan Indonesia Persero PT | | | |
| 4,250 % éch. 05/05/2025 | 6 500 | 6 381 | 0,17 |
| 4,875 % éch. 01/10/2024 | 3 100 | 3 079 | 0,08 |
| 5,375 % éch. 05/05/2045 | 3 693 | 3 594 | 0,09 |
| Pertamina Persero PT | | | |
| 1,400 % éch. 09/02/2026 | 600 | 557 | 0,01 |
| 4,175 % éch. 21/01/2050 | 5 000 | 4 183 | 0,11 |
| 5,625 % éch. 20/05/2043 | 1 800 | 1 825 | 0,05 |
| 6,000 % éch. 03/05/2042 | 18 900 | 19 949 | 0,52 |
| 6,450 % éch. 30/05/2044 | 12 400 | 13 607 | 0,35 |
| 6,500 % éch. 07/11/2048 | 9 500 | 10 642 | 0,28 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | CONSTELLATION OIL SERVICES HOLDING S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) | | | |
| 4,000 % éch. 30/06/2050 | \$ 16 800 | \$ 13 032 | 0,34 | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | € 6 300 | \$ 5 885 | 0,15 | 3,000 % éch. 31/12/2026 (a) | \$ 3 893 | \$ 2 832 | 0,07 |
| 4,125 % éch. 15/05/2027 | 5 600 | 5 452 | 0,14 | 4,875 % éch. 30/01/2032 | € 300 | 265 | 0,01 | FORESEA Holding S.A. | 6 316 | 5 855 | 0,15 |
| 4,375 % éch. 05/02/2050 | 2 900 | 2 404 | 0,06 | 6,625 % éch. 22/03/2048 | | 6 150 | 0,16 | Greensaif Pipelines Bidco SARL | 6 129 | 4 909 | 0,13 |
| 5,250 % éch. 24/10/2042 | 2 300 | 2 179 | 0,06 | Total Côte d'Ivoire | | 9 358 | 0,24 | 6,510 % éch. 23/02/2042 | 4 600 | 4 871 | 0,13 |
| 5,250 % éch. 15/05/2047 | 8 400 | 7 888 | 0,20 | JAMAÏQUE | | | | GUARA NORTE SARL | | | |
| 6,150 % éch. 21/05/2048 | 2 700 | 2 773 | 0,07 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,198 % éch. 15/06/2034 | | | |
| 6,250 % éch. 25/01/2049 | 7 800 | 8 131 | 0,21 | TransJamaican Highway Ltd. | | | | Petrorio Luxembourg Trading SARL | 6 125 | 6 977 | 0,18 |
| | | 117 528 | 3,05 | 5,750 % éch. 10/10/2036 | \$ 3 216 | 2 820 | 0,07 | TMS Issuer SARL | 5 780 | 6 902 | 0,18 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | JAPON | | | | UNIGEL LUXEMBOURG S.A. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 8,750 % éch. 01/10/2026^ | | | |
| 4,750 % éch. 18/07/2047 (j) | 2 700 | 2 680 | 0,07 | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | 16 500 | 16 442 | 0,43 | | 56 196 | 1,46 |
| 5,350 % éch. 11/02/2049 | 200 | 214 | 0,01 | 5,063 % éch. 12/09/2025 | | | | Total Luxembourg | | 68 788 | 1,79 |
| 5,650 % éch. 11/01/2053 | 800 | 883 | 0,02 | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | MACÉDOINE DU NORD | | | |
| 6,625 % éch. 17/02/2037 | 5 900 | 6 932 | 0,18 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 6,750 % éch. 15/01/2044 | 7 000 | 8 635 | 0,23 | Corsair International Ltd. | € 15 900 | 17 564 | 0,45 | Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du nord | | | |
| 7,750 % éch. 17/01/2038 | 1 000 | 1 285 | 0,03 | 8,802 % éch. 28/01/2027 | € 6 900 | 7 622 | 0,20 | 6,960 % éch. 13/03/2027 | € 7 700 | 8 907 | 0,23 |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia | | | | 9,152 % éch. 28/01/2029 | | | | | | | |
| 3,800 % éch. 23/06/2050 | 7 000 | 5 862 | 0,15 | Total Jersey, Îles Anglo-normandes | | 25 186 | 0,65 | MALAISIE | | | |
| | | 26 491 | 0,69 | JORDANIE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Total Indonésie | | 144 019 | 3,74 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Axiata SPV2 Bhd. | | | |
| INTERNATIONALES | | | | Obligation internationale du gouvernement jordanien | | | | 2,163 % éch. 19/08/2030 | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | 4,950 % éch. 07/07/2025 | | | | \$ 1 900 | | | |
| Project Mercury | € 6 700 | 7 424 | 0,20 | 5,750 % éch. 31/01/2027 | \$ 2 200 | 2 158 | 0,06 | Khazanah Capital Ltd. | 6 100 | 6 133 | 0,16 |
| 8,127 % éch. 11/08/2030 | | | | 6,125 % éch. 29/01/2026 | 6 250 | 6 245 | 0,16 | 4,876 % éch. 01/06/2033 | | | |
| State Oil Co. of the Azerbaijan Republic | \$ 500 | 496 | 0,01 | 7,375 % éch. 10/10/2047 | 700 | 624 | 0,02 | Khazanah Global Sukuk Bhd. | 8 200 | 8 230 | 0,22 |
| 8,305 % éch. 26/11/2024 | | | | Total Jordanie | | 11 391 | 0,30 | 4,687 % éch. 01/06/2028 | | | |
| Total Internationales | | 7 920 | 0,21 | KAZAKHSTAN | | | | PETRONAS CAPITAL LTD. | | | |
| IRAK | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,550 % éch. 21/04/2050 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | KazMunayGas National Co. JSC | | | | Total Malaisie | | | |
| Obligation internationale du gouvernement irakien | | | | 3,500 % éch. 14/04/2033 | | | | 24 909 | | | |
| 5,800 % éch. 15/01/2028 | 3 375 | 3 164 | 0,08 | 4,750 % éch. 19/04/2027 | 16 600 | 16 177 | 0,42 | ACTIONS | | | |
| IRLANDE | | | | 5,750 % éch. 19/04/2047 | | | | MEXIQUE | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | 6,375 % éch. 24/10/2048 | | | | CTIONS ORDINAIRES | | | |
| Avoca Static CLO DAC | € 1 700 | 1 877 | 0,05 | Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. | 3 250 | 4 463 | 0,12 | Actions ordinaires | | | |
| 5,690 % éch. 15/10/2030 | | | | Total Kazakhstan | | 39 815 | 1,03 | Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. (b) | 39 443 | 0 | 0,00 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | KENYA | | | | Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (b) | | | |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2 622 | | | |
| 5,950 % éch. 15/04/2030 ^ (h) | \$ 6 600 | 396 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement kenyan | | | | Total Actions ordinaires | | | |
| Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC | | | | 6,875 % éch. 24/06/2024 | 3 750 | 3 652 | 0,10 | | | | |
| 5,927 % éch. 19/02/2027 | 19 815 | 18 478 | 0,48 | 7,000 % éch. 22/05/2027 | 2 400 | 2 258 | 0,06 | | | | |
| Sadereza DAC | | | | 7,250 % éch. 28/02/2028 | 800 | 734 | 0,02 | | | | |
| 12,500 % éch. 30/11/2026 ^ | 10 373 | 4 512 | 0,12 | 8,000 % éch. 22/05/2032 | 1 900 | 1 725 | 0,04 | | | | |
| | | 23 386 | 0,61 | Total Kenya | | 8 369 | 0,22 | | | | |
| Total Irlande | | 25 263 | 0,66 | LIBAN | | | | 6,750 % éch. 27/06/2029 | | | |
| ISRAËL | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | (f)(h) | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Obligation internationale du gouvernement libanais | | | | 5 400 | | | |
| Bank Hapoalim B.M. | | | | 8,250 % éch. 17/05/2034 ^ | 9 700 | 604 | 0,02 | | | | |
| 3,255 % éch. 21/01/2032 (h) | 9 900 | 8 606 | 0,22 | LUXEMBOURG | | | | Comision Federal de Electricidad | | | |
| Israel Electric Corp. Ltd. | | | | CTIONS ORDINAIRES | | | | 6,264 % éch. 15/02/2052 | | | |
| 4,250 % éch. 14/08/2028 | 5 000 | 4 692 | 0,12 | DrillCo Holding Lux S.A. (b) | 143 033 | 3 552 | 0,09 | Corp. GEO S.A.B. de C.V. | 8 875 | 0 | 0,00 |
| 5,000 % éch. 12/11/2024 | 200 | 198 | 0,01 | DrillCo Holding Lux S.A. (b)(i) | 364 034 | 9 040 | 0,24 | 8,875 % éch. 25/09/2014 ^ | 13 920 | 0 | 0,00 |
| Leviathan Bond Ltd. | | | | Total Actions ordinaires | | 12 592 | 0,33 | 9,250 % éch. 30/06/2020 ^ | 1 000 | 0 | 0,00 |
| 6,125 % éch. 30/06/2025 | 2 100 | 2 041 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Industrias Penoles S.A.B. de C.V. | | | |
| 6,500 % éch. 30/06/2027 | 6 800 | 6 414 | 0,17 | Chile Electricity Lux MPC SARL | | | | 4,750 % éch. 06/08/2050 | | | |
| | | 21 951 | 0,57 | 6,010 % éch. 20/01/2033 | \$ 8 800 | 9 032 | 0,23 | Petroleos Mexicanos | 3 625 | 1 453 | 0,04 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Constellation Oil Services Holding S.A. | | | | 3,625 % éch. 24/11/2025 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement israélien | | | | 13,500 % éch. 30/06/2025 | | | | 4,875 % éch. 21/02/2028 | | | |
| 5,000 % éch. 30/10/2026 (j) | € 39 500 | 44 656 | 1,16 | | | | | 6,350 % éch. 12/02/2048 | \$ 30 367 | 19 307 | 0,50 |
| Total Israël | | 66 607 | 1,73 | CTIONS | | | | 6,500 % éch. 02/06/2041 | | | |
| CÔTE D'IVOIRE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,625 % éch. 15/06/2035 | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | Chile Electricity Lux MPC SARL | | | | 6,625 % éch. 15/06/2038 | | | |
| République de Côte d'Ivoire | | | | 6,700 % éch. 16/02/2032 | | | | 6,700 % éch. 16/02/2032 | 12 558 | 10 435 | 0,27 |
| 9,055 % éch. 19/03/2027 | 3 010 | 3 208 | 0,08 | 6,750 % éch. 21/09/2047 | | | | 6,750 % éch. 21/09/2047 | 17 180 | 11 263 | 0,29 |
| | | | | 6,840 % éch. 23/01/2030 | | | | 6,840 % éch. 23/01/2030 | 278 | 241 | 0,01 |
| | | | | 6,950 % éch. 28/01/2060 | | | | 6,950 % éch. 28/01/2060 | 29 647 | 19 563 | 0,51 |
| | | | | 7,690 % éch. 23/01/2050 | | | | 7,690 % éch. 23/01/2050 | 66 636 | 47 474 | 1,23 |
| | | | | 10,000 % éch. 07/02/2033 (j) | | | | 10,000 % éch. 07/02/2033 (j) | 9 950 | 10 002 | 0,26 |
| | | | | SITIOS LATINOAMERICA S.A.B. DE C.V. | | | | 5,375 % éch. 04/04/2032 | | | |
| | | | | | | | | 7 250 | 6 746 | 0,18 | |
| | | | | | | | | | 154 996 | 4,03 | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | |
| 2,750 % éch. 27/11/2031 (e) MXN | 263 393 | \$ 13 734 | 0,36 |
| 3,000 % éch. 03/12/2026 (e) | 820 381 | 45 003 | 1,17 |
| 3,750 % éch. 19/04/2071 | \$ 9 200 | 6 168 | 0,16 |
| 3,771 % éch. 24/05/2061 | 15 400 | 10 489 | 0,27 |
| 4,000 % éch. 30/11/2028 (e) MXN | 124 441 | 7 186 | 0,19 |
| 5,000 % éch. 27/04/2051 (j) | \$ 14 100 | 12 276 | 0,32 |
| 5,750 % éch. 12/10/2110 | 53 450 | 48 034 | 1,25 |
| 6,338 % éch. 04/05/2053 | 1 285 | 1 311 | 0,03 |
| 6,350 % éch. 09/02/2035 | 15 700 | 16 487 | 0,43 |
| 6,750 % éch. 27/09/2034 | 4 570 | 4 970 | 0,13 |
| | | 165 658 | 4,31 |
| Total Mexique | | 320 655 | 8,34 |
| MONGOLIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement mongol | | | |
| 7,875 % éch. 05/06/2029 | 1 300 | 1 331 | 0,03 |
| MAROC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OCP S.A. | | | |
| 3,750 % éch. 23/06/2031 | 10 650 | 9 184 | 0,24 |
| 5,125 % éch. 23/06/2051 | 4 300 | 3 275 | 0,09 |
| | | 12 459 | 0,33 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement marocain | | | |
| 5,500 % éch. 11/12/2042 | 9 000 | 8 212 | 0,21 |
| Total Maroc | | 20 671 | 0,54 |
| MULTINATIONALES | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ATP Tower Holdings LLC | | | |
| 4,050 % éch. 27/04/2026 | 10 600 | 9 636 | 0,25 |
| NAMIBIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement namibien | | | |
| 5,250 % éch. 29/10/2025 | 6 000 | 5 943 | 0,15 |
| PAYS-BAS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Metinvest BV | | | |
| 8,500 % éch. 23/04/2026 | 5 700 | 4 018 | 0,10 |
| Prosus NV | | | |
| 1,539 % éch. 03/08/2028 | € 2 400 | 2 294 | 0,06 |
| 2,031 % éch. 03/08/2032 | 1 200 | 1 017 | 0,03 |
| 3,257 % éch. 19/01/2027 | \$ 2 400 | 2 219 | 0,06 |
| 3,832 % éch. 08/02/2051 | 2 100 | 1 321 | 0,03 |
| 4,027 % éch. 03/08/2050 | 1 600 | 1 051 | 0,03 |
| Total Pays-Bas | | 11 920 | 0,31 |
| NIGERIA | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| BOI Finance BV | | | |
| 7,500 % éch. 16/02/2027 | € 14 400 | 14 663 | 0,38 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement nigérian | | | |
| 6,125 % éch. 28/09/2028 | \$ 2 000 | 1 778 | 0,05 |
| 6,500 % éch. 28/11/2027 | 3 544 | 3 249 | 0,09 |
| 7,143 % éch. 23/02/2030 | 5 800 | 5 241 | 0,14 |
| 7,375 % éch. 28/09/2033 | 600 | 513 | 0,01 |
| 7,625 % éch. 28/11/2047 | 9 846 | 7 837 | 0,20 |
| 7,696 % éch. 23/02/2038 | 4 800 | 3 949 | 0,10 |
| 7,875 % éch. 16/02/2032 | 8 100 | 7 304 | 0,19 |
| 8,250 % éch. 28/09/2051 | 4 400 | 3 624 | 0,09 |
| 8,375 % éch. 24/03/2029 | 2 600 | 2 503 | 0,07 |
| | | 35 998 | 0,94 |
| Total Nigeria | | 50 661 | 1,32 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| OMAN | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement omanais | | | |
| 4,875 % éch. 01/02/2025 | \$ 1 100 | \$ 1 093 | 0,03 |
| 5,625 % éch. 17/01/2028 | 6 690 | 6 830 | 0,18 |
| 6,000 % éch. 01/08/2029 | 16 100 | 16 715 | 0,43 |
| 6,250 % éch. 25/01/2031 | 7 000 | 7 377 | 0,19 |
| 6,500 % éch. 08/03/2047 | 3 473 | 3 552 | 0,09 |
| 6,750 % éch. 28/10/2027 | 13 300 | 14 066 | 0,36 |
| 6,750 % éch. 17/01/2048 | 3 900 | 4 091 | 0,11 |
| 7,000 % éch. 25/01/2051 | 2 400 | 2 597 | 0,07 |
| Total Oman | | 56 321 | 1,46 |
| PAKISTAN | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement pakistanais | | | |
| 6,000 % éch. 08/04/2026 | 5 952 | 4 220 | 0,11 |
| 6,875 % éch. 05/12/2027 | 4 747 | 3 258 | 0,08 |
| 7,375 % éch. 08/04/2031 | 5 439 | 3 334 | 0,09 |
| 8,250 % éch. 15/04/2024 | 2 866 | 2 725 | 0,07 |
| 8,875 % éch. 08/04/2051 | 27 405 | 16 658 | 0,43 |
| Pakistan Water & Power Development Authority | | | |
| 7,500 % éch. 04/06/2031 | 5 020 | 2 664 | 0,07 |
| Total Pakistan | | 32 859 | 0,85 |
| PANAMA | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A. | | | |
| 5,125 % éch. 11/08/2061 | 7 100 | 5 416 | 0,14 |
| Banco General S.A. | | | |
| 5,250 % éch. 07/05/2031 | | | |
| (f)(h) | 400 | 344 | 0,01 |
| 5,250 % éch. 07/05/2031 (f) | 8 300 | 7 137 | 0,19 |
| Banco Nacional de Panama | | | |
| 2,500 % éch. 11/08/2030 | 6 100 | 4 533 | 0,12 |
| | | 17 430 | 0,46 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen | | | |
| 3,870 % éch. 23/07/2060 | 1 400 | 842 | 0,02 |
| 4,300 % éch. 29/04/2053 | 9 900 | 6 656 | 0,17 |
| 4,500 % éch. 15/05/2047 | 6 100 | 4 349 | 0,11 |
| 4,500 % éch. 16/04/2050 | 6 600 | 4 596 | 0,12 |
| 4,500 % éch. 01/04/2056 | 3 400 | 2 292 | 0,06 |
| 4,500 % éch. 19/01/2063 | 8 200 | 5 385 | 0,14 |
| 6,400 % éch. 14/02/2035 | 13 900 | 13 602 | 0,35 |
| 6,700 % éch. 26/01/2036 | 3 800 | 3 775 | 0,10 |
| 6,853 % éch. 28/03/2054 | 5 400 | 5 066 | 0,13 |
| 6,875 % éch. 31/01/2036 | 2 500 | 2 501 | 0,07 |
| 8,125 % éch. 28/04/2034 | 300 | 319 | 0,01 |
| 8,875 % éch. 30/09/2027 | 1 700 | 1 862 | 0,05 |
| | | 51 245 | 1,33 |
| Total Panama | | 68 675 | 1,79 |
| PARAGUAY | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen | | | |
| 2,739 % éch. 29/01/2033 | 1 900 | 1 568 | 0,04 |
| 3,849 % éch. 28/06/2033 | 2 200 | 1 957 | 0,05 |
| 4,700 % éch. 27/03/2027 | 1 800 | 1 778 | 0,05 |
| 5,400 % éch. 30/03/2050 | 4 400 | 3 924 | 0,10 |
| 5,850 % éch. 21/08/2033 | 3 600 | 3 666 | 0,10 |
| 6,100 % éch. 11/08/2044 | 2 400 | 2 364 | 0,06 |
| Total Paraguay | | 15 257 | 0,40 |
| PÉROU | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banco de Credito del Peru S.A. | | | |
| 4,650 % éch. 17/09/2024 | PEN 26 100 | 6 846 | 0,18 |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. | | | |
| 10,100 % éch. 15/12/2043 | 14 200 | 3 869 | 0,10 |
| InRetail Consumer | | | |
| 3,250 % éch. 22/03/2028 | \$ 4 600 | 4 132 | 0,11 |
| Petroleos del Peru S.A. | | | |
| 4,750 % éch. 19/06/2032 | 2 600 | 1 869 | 0,05 |
| 5,625 % éch. 19/06/2047 | 17 869 | 11 025 | 0,28 |
| | | 27 741 | 0,72 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | |
| 3,230 % éch. 28/07/2121 | \$ 1 900 | \$ 1 186 | 0,03 |
| 3,600 % éch. 15/01/2072 | 2 600 | 1 840 | 0,05 |
| 6,550 % éch. 14/03/2037 | 14 243 | 15 907 | 0,41 |
| 8,750 % éch. 21/11/2033 | 185 | 234 | 0,01 |
| | | 19 167 | 0,50 |
| Total Pérou | | 46 908 | 1,22 |
| PHILIPPINES | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement philippin | | | |
| 2,650 % éch. 10/12/2045 | 7 400 | 5 280 | 0,14 |
| 2,950 % éch. 05/05/2045 | 1 600 | 1 205 | 0,03 |
| 3,700 % éch. 01/03/2041 | 650 | 559 | 0,01 |
| 5,000 % éch. 17/07/2033 | 6 800 | 6 997 | 0,18 |
| 6,375 % éch. 23/10/2034 | 847 | 962 | 0,03 |
| 9,500 % éch. 02/02/2030 | 4 179 | 5 268 | 0,14 |
| Total Philippines | | 20 271 | 0,53 |
| POLOGNE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Bank Gospodarstwa Krajowego | | | |
| 6,250 % éch. 31/10/2028 | 8 000 | 8 459 | 0,22 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais | | | |
| 4,875 % éch. 04/10/2033 | 13 400 | 13 618 | 0,35 |
| 5,500 % éch. 16/11/2027 | 10 250 | 10 657 | 0,28 |
| 5,500 % éch. 04/04/2053 | 9 500 | 9 931 | 0,26 |
| Total Pologne | | 42 665 | 1,11 |
| QATAR | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| QatarEnergy | | | |
| 1,375 % éch. 12/09/2026 | 15 800 | 14 519 | 0,37 |
| 2,250 % éch. 12/07/2031 | 9 000 | 7 673 | 0,20 |
| 3,125 % éch. 12/07/2041 | 27 350 | 21 082 | 0,55 |
| 3,300 % éch. 12/07/2051 | 1 200 | 879 | 0,02 |
| 3,300 % éch. 12/07/2051 (j) | 41 100 | 30 111 | 0,78 |
| Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. | | | |
| 5,838 % éch. 30/09/2027 | 1 037 | 1 056 | 0,03 |
| 6,332 % éch. 30/09/2027 | 258 | 264 | 0,01 |
| | | 75 584 | 1,96 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement qatari | | | |
| 4,400 % éch. 16/04/2050 | 7 100 | 6 558 | 0,17 |
| 4,625 % éch. 02/06/2046 | 300 | 287 | 0,01 |
| 4,817 % éch. 14/03/2049 | 1 800 | 1 756 | 0,05 |
| 5,103 % éch. 23/04/2048 | 12 280 | 12 460 | 0,32 |
| | | 21 061 | 0,55 |
| Total Qatar | | 96 645 | 2,51 |
| ROUMANIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement roumain | | | |
| 2,000 % éch. 08/12/2026 (j) | € 5 600 | 5 824 | 0,15 |
| 2,125 % éch. 07/03/2028 (j) | 3 600 | 3 617 | 0,09 |
| 2,625 % éch. 02/12/2040 (j) | 7 400 | 5 519 | 0,14 |
| 2,875 % éch. 13/04/2042 (j) | 3 400 | 2 551 | 0,07 |
| 5,000 % éch. 27/09/2026 (j) | 13 300 | 15 103 | 0,39 |
| 6,125 % éch. 22/01/2044 | \$ 4 050 | 4 006 | 0,11 |
| 6,375 % éch. 18/09/2033 (j) | € 11 400 | 13 340 | 0,35 |
| 7,625 % éch. 17/01/2053 | \$ 9 500 | 10 675 | 0,28 |
| Total Roumanie | | 60 635 | 1,58 |
| RUSSIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement russe | | | |
| 1,125 % éch. 20/11/2027 ^ | € 100 | 45 | 0,00 |
| 5,250 % éch. 23/06/2047 ^ | \$ 200 | 71 | 0,00 |
| 7,500 % éch. 31/03/2030 ^ | 174 | 114 | 0,01 |
| Total Russie | | 230 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------|-------|------|
| ARABIE SAOUDITE | | | | THAÏLANDE | | | | THAÏLANDE | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| Saudi Arabian Oil Co. | | | | Kodit Global Co. Ltd. | | | | Bangkok Bank PCL | | | | | | |
| 1,625 % éch. 24/11/2025 | \$ 6 075 | \$ 5 724 | 0,15 | 5,000 % éch. 12/10/2046 | \$ 10 200 | \$ 7 579 | 0,20 | 3,733 % éch. 25/09/2034 (h) | \$ 800 | \$ 712 | 0,02 | | | |
| 2,250 % éch. 24/11/2030 | 4 500 | 3 875 | 0,10 | 5,375 % éch. 24/07/2044 | 400 | 320 | 0,01 | PTTEP Treasury Center Co. Ltd. | | | | | | |
| 2,875 % éch. 16/04/2024 | 600 | 595 | 0,02 | 5,750 % éch. 30/09/2049 | 6 400 | 5 130 | 0,13 | 2,587 % éch. 10/06/2027 | 1 300 | 1 208 | 0,03 | | | |
| 3,500 % éch. 16/04/2029 | 3 000 | 2 844 | 0,07 | 7,300 % éch. 20/04/2052 | 5 300 | 5 035 | 0,13 | 3,903 % éch. 06/12/2059 | 550 | 438 | 0,01 | | | |
| 3,500 % éch. 24/11/2070 | 45 000 | 31 050 | 0,81 | | | 81 974 | 2,13 | Total Thaïlande | | | 2 358 0,06 | | | |
| | | 44 088 | 1,15 | Total Afrique du Sud | | 172 236 | 4,48 | TRINITÉ-ET-TOBAGO | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | CORÉE DU SUD | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite | | | | Obligations et billets privés | | | | Obligation internationale du gouvernement de Trinité-et-Tobago | | | | | | |
| 0,000 % éch. 03/03/2024 (c) | € 1 500 | 1 645 | 0,04 | Kodit Global Co. Ltd. | | 1 697 | 0,04 | 5,950 % éch. 14/01/2031 | 5 800 | 6 019 | 0,16 | | | |
| 2,250 % éch. 02/02/2033 | \$ 1 700 | 1 411 | 0,04 | 4,954 % éch. 25/05/2026 | \$ 1 700 | 1 697 | 0,04 | TUNISIE | | | | | | |
| 3,250 % éch. 22/10/2030 | 2 000 | 1 859 | 0,05 | SK on Co. Ltd. | | 4 934 | 0,13 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| 3,450 % éch. 02/02/2061 | 9 900 | 6 985 | 0,18 | 5,375 % éch. 11/05/2026 | 4 900 | 6 631 | 0,17 | Obligation internationale du gouvernement de la Banque centrale de Tunisie | | | | | | |
| 3,750 % éch. 21/01/2055 | 8 600 | 6 567 | 0,17 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 3,280 % éch. 09/08/2027 | | | | ¥ 200 000 | 788 | 0,02 |
| 4,500 % éch. 26/10/2046 (j) | 26 600 | 23 609 | 0,61 | Korea Electric Power Corp. | | 10 114 | 0,26 | 5,625 % éch. 17/02/2024 | € 9 470 | 10 136 | 0,27 | | | |
| 4,625 % éch. 04/10/2047 | 300 | 270 | 0,01 | 5,375 % éch. 31/07/2026 | 10 000 | 10 114 | 0,26 | 5,750 % éch. 30/01/2025 | \$ 12 200 | 10 045 | 0,26 | | | |
| 4,750 % éch. 18/01/2028 | 8 300 | 8 396 | 0,22 | Korea National Oil Corp. | | 15 896 | 0,42 | 6,375 % éch. 15/07/2026 | € 5 505 | 4 254 | 0,11 | | | |
| 4,750 % éch. 18/01/2028 (j) | 27 600 | 27 918 | 0,72 | 4,875 % éch. 03/04/2028 | 15 800 | 26 010 | 0,68 | Total Tunisie | | | 25 223 0,66 | | | |
| | | 78 660 | 2,04 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | TURQUIE | | | | | | |
| Total Arabie saoudite | | 122 748 | 3,19 | Total Corée du Sud | | 32 641 | 0,85 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| SÉNÉGAL | | | | ESPAGNE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement sénégalais | | | | Banco Santander S.A. | | | | Turkish Airlines Pass-Through Trust | | | | | | |
| 4,750 % éch. 13/03/2028 | € 3 400 | 3 480 | 0,09 | 5,147 % éch. 18/08/2025 | 13 600 | 13 526 | 0,35 | 4,200 % éch. 15/09/2028 | \$ 4 022 | 3 810 | 0,10 | | | |
| 5,375 % éch. 08/06/2037 | 25 500 | 20 901 | 0,54 | SRI LANKA | | | | Turkiye İs Bankası A/S | | | | | | |
| Total Sénégal | | 24 381 | 0,63 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 6,125 % éch. 25/04/2024 | | | | 2 200 | 2 200 | 0,06 |
| SERBIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement serbe | | | | Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka | | | | Export-Credit Bank of Turkey | | | | | | |
| 1,500 % éch. 26/06/2029 | 12 400 | 11 589 | 0,30 | 5,750 % éch. 18/04/2023 ^ | 3 770 | 1 939 | 0,05 | 5,750 % éch. 06/07/2026 | \$ 3 500 | 3 411 | 0,09 | | | |
| 6,250 % éch. 26/05/2028 | \$ 9 600 | 9 846 | 0,26 | 5,875 % éch. 25/07/2022 ^ | 2 050 | 1 086 | 0,03 | Hazine Mustesarlığı Varlık Kiralama A/S | | | | | | |
| 6,500 % éch. 26/09/2033 | 1 150 | 1 183 | 0,03 | 6,125 % éch. 03/06/2025 ^ | 5 100 | 2 633 | 0,07 | 8,509 % éch. 14/01/2029 | 12 600 | 13 382 | 0,35 | | | |
| 6,500 % éch. 26/09/2033 (j) | 24 000 | 24 690 | 0,64 | 6,200 % éch. 11/05/2027 ^ | 8 700 | 4 418 | 0,11 | Obligation internationale du gouvernement turc | | | | | | |
| Total Serbie | | 47 308 | 1,23 | 6,350 % éch. 28/06/2024 ^ | 1 420 | 723 | 0,02 | 4,875 % éch. 16/04/2043 | 7 500 | 5 496 | 0,14 | | | |
| SINGAPOUR | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| Flex Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement du Ghana | | | | Obligation internationale du gouvernement ukrainien | | | | | | |
| 4,875 % éch. 15/06/2029 | 1 300 | 1 279 | 0,03 | 10,750 % éch. 14/10/2030 | 1 050 | 665 | 0,02 | 6,876 % éch. 21/05/2031 | 2 400 | 558 | 0,01 | | | |
| Singapore Airlines Ltd. | | | | Total Sri Lanka | | 27 874 | 0,72 | 7,253 % éch. 15/03/2035 | 11 139 | 2 646 | 0,07 | | | |
| 3,375 % éch. 19/01/2029 | 7 800 | 7 311 | 0,19 | SUPRANATIONALES | | | | 7,375 % éch. 25/09/2034 | | | | 5 020 | 1 199 | 0,03 |
| Total Singapour | | 8 590 | 0,22 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 7,750 % éch. 01/09/2026 | | | | 5 000 | 1 402 | 0,04 |
| SLOVÉNIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement slovène | | | | Banque de développement et de commerce d'Afrique orientale et australe | | | | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | | | | | | |
| 5,000 % éch. 19/09/2033 | 12 500 | 12 744 | 0,33 | 4,125 % éch. 30/06/2028 | 7 300 | 6 325 | 0,16 | 6,915 % éch. 28/06/2024 | € 25 500 | 28 181 | 0,73 | | | |
| AFRIQUE DU SUD | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC | | | | Obligation internationale du gouvernement du Ghana | | | | 7,750 % éch. 01/09/2027 | | | | 3 300 | 907 | 0,02 |
| 3,750 % éch. 01/10/2030 | 3 600 | 3 132 | 0,08 | Total Supranationales | | 6 990 | 0,18 | 7,750 % éch. 01/08/2041 | 18 700 | 8 420 | 0,22 | | | |
| 6,500 % éch. 15/04/2040 | 200 | 196 | 0,01 | SUISSE | | | | 8,994 % éch. 01/02/2026 | | | | 7 500 | 2 252 | 0,06 |
| Banque de développement d'Afrique du Sud | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| 8,600 % éch. 21/10/2024 | ZA | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | |
| (i) | R | 467 300 | 25 473 | Credit Suisse AG | | | | Obligation internationale du gouvernement ukrainien | | | | | | |
| Eskom Holdings SOC Ltd. | | | | 4,750 % éch. 09/08/2024 | 6 000 | 5 965 | 0,15 | 6,876 % éch. 21/05/2031 | 2 400 | 558 | 0,01 | | | |
| 4,314 % éch. 23/07/2027 | \$ 13 650 | 12 788 | 0,33 | UBS Group AG | | 1 077 | 0,03 | 7,253 % éch. 15/03/2035 | 11 139 | 2 646 | 0,07 | | | |
| 6,350 % éch. 10/08/2028 | 14 400 | 14 046 | 0,37 | 2,593 % éch. 11/09/2025 | 1 100 | 1 077 | 0,03 | 7,375 % éch. 25/09/2034 | 5 020 | 1 199 | 0,03 | | | |
| 7,125 % éch. 11/02/2025 | 4 588 | 4 596 | 0,12 | 6,373 % éch. 15/07/2026 | 4 500 | 4 554 | 0,12 | 7,750 % éch. 01/09/2026 | 5 000 | 1 402 | 0,04 | | | |
| 8,450 % éch. 10/08/2028 | 13 200 | 13 420 | 0,35 | Total Suisse | | 11 596 | 0,30 | 7,750 % éch. 01/09/2027 | 3 300 | 907 | 0,02 | | | |
| Sasol Financing USA LLC | | | | TANZANIE | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | |
| 5,875 % éch. 27/03/2024 | 5 815 | 5 785 | 0,15 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | | | | | | |
| 8,750 % éch. 03/05/2029 | 10 600 | 10 826 | 0,28 | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | | | | 7,750 % éch. 01/08/2041 | | | | 18 700 | 8 420 | 0,22 |
| | | 90 262 | 2,35 | Ministère des Finances et de la Planification, Gouvernement de la République unie de Tanzanie | | | | 8,994 % éch. 01/02/2026 | | | | 7 500 | 2 252 | 0,06 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | | | | Obligation internationale du gouvernement ukrainien | | | | | | |
| 4,300 % éch. 12/10/2028 | 800 | 750 | 0,02 | 9,502 % éch. 26/04/2028 | 10 064 | 11 033 | 0,29 | 6,876 % éch. 21/05/2031 | 2 400 | 558 | 0,01 | | | |
| 4,850 % éch. 30/09/2029 | 11 100 | 10 437 | 0,27 | Total Tanzanie | | 39 214 | 1,02 | 7,253 % éch. 15/03/2035 | 11 139 | 2 646 | 0,07 | | | |
| | | | | | | | | Total Turquie | | | | 205 322 5,34 | | |
| | | | | | | | | Total Ukraine | | | | 17 846 0,46 | | |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 500 | \$ 2 | 0,00 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 % | 20/10/2033 | £ 1 100 | \$ 123 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 21/09/2024 | \$ 90 600 | (5) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2029 | 11 100 | (1 102) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 21/06/2027 | 13 700 | (1 916) | (0,05) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 400 | (45) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2024 | 93 700 | (477) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/12/2031 | 5 700 | (885) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250 | 21/12/2046 | 1 200 | 540 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 15/06/2046 | 600 | 279 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 152 400 | (4 412) | (0,12) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 40 500 | 2 137 | 0,06 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 12 640 | 723 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730 | 03/08/2033 | 3 300 | 59 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735 | 07/08/2033 | 3 700 | 70 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 2 100 | 97 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 2 300 | 226 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870 | 17/10/2053 | 1 900 | 201 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880 | 16/10/2053 | 2 300 | 248 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 300 | 14 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 4 500 | 258 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155 | 02/10/2033 | 6 200 | 355 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165 | 27/09/2033 | 7 200 | 418 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 8 900 | 522 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 5 300 | 313 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 4 000 | 253 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 | 23/10/2033 | 2 200 | 141 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2034 | 12 500 | (124) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255 | 23/10/2033 | 2 400 | 159 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393 | 25/10/2033 | 400 | 31 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 3 800 | 317 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,850 | 02/01/2025 | BRL 87 000 | 25 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,240 | 02/01/2025 | 210 200 | 79 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,055 | 04/01/2027 | 102 700 | (1 400) | (0,04) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,216 | 02/01/2025 | 36 500 | (190) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,241 | 02/01/2025 | 38 600 | (204) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,427 | 02/01/2025 | 86 600 | (514) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,428 | 02/01/2025 | 124 500 | 743 | 0,02 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,950 | 30/11/2024 | ZAR 560 000 | 655 | 0,02 |
| À payer ⁽³⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | AUD 138 400 | 2 124 | 0,05 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2028 | 59 100 | 1 524 | 0,04 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,855 | 18/12/2033 | CLP 10 615 700 | (70) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,511 | 13/11/2033 | 11 556 400 | (562) | (0,01) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,175 | 07/11/2028 | CZK 1 701 000 | 1 909 | 0,05 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,611 | 06/06/2028 | 186 600 | 354 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 16 000 | (720) | (0,02) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 30 200 | 656 | 0,02 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 70 700 | 3 504 | 0,09 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 5 100 | 399 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 1 800 | 82 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,450 | 20/10/2028 | 8 200 | 408 | 0,01 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,455 | 10/01/2028 | PLN 24 000 | (340) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,490 | 10/01/2028 | 22 800 | (332) | (0,01) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,769 | 27/09/2028 | MXN 170 620 | (458) | (0,01) |
| | | | | | \$ 6 190 | 0,16 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 6 192 | 0,16 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BPS | Option de vente - GBP contre USD hors cote | \$ 1,160 | 12/06/2024 | 58 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| MYI | Option de vente - GBP contre USD hors cote | 1,160 | 12/06/2024 | 73 182 | 291 | 156 | 0,00 |
| | | | | | \$ 291 | \$ 156 | 0,00 |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 3 800 | \$ (78) | \$ (10) | \$ (88) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement omanais | (1,000) | 20/12/2027 | 2 300 | 75 | (79) | (4) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | (1,000) | 20/12/2028 | 54 600 | (827) | (375) | (1 202) | (0,03) |
| BPS | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) | 20/12/2028 | 2 590 | (52) | (8) | (60) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement omanais | (1,000) | 20/12/2027 | 1 100 | 36 | (38) | (2) | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement omanais | (1,000) | 20/12/2027 | 2 400 | 64 | (68) | (4) | 0,00 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) | 20/12/2028 | 190 | (4) | 0 | (4) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) | 20/12/2028 | 15 400 | (453) | (64) | (517) | (0,01) |
| HUS | Obligation internationale du gouvernement de Dubaï | (1,000) | 20/12/2024 | 3 600 | (12) | (18) | (30) | 0,00 |
| JPM | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) | 20/12/2028 | 4 500 | (91) | (13) | (104) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement de Dubaï | (1,000) | 20/12/2024 | 1 500 | (2) | (11) | (13) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | (1,000) | 20/06/2026 | 27 500 | 1 274 | (1 240) | 34 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | (1,000) | 20/12/2025 | 6 300 | 608 | (552) | 56 | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) | 20/12/2028 | 6 320 | (128) | (18) | (146) | (0,01) |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | (1,000) | 20/12/2026 | 800 | 135 | (113) | 22 | 0,00 |
| | | | | | \$ 545 | \$ (2 607) | \$ (2 062) | (0,05) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 8 100 | \$ 26 | \$ 13 | \$ 39 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2026 | 700 | 4 | 12 | 16 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2027 | 5 000 | (18) | 139 | 121 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement égyptien | 1,000 | 20/12/2024 | 1 300 | (156) | 68 | (88) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2028 | 12 900 | (17) | 192 | 175 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 13 200 | 4 | 56 | 60 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement nigérian | 1,000 | 20/12/2028 | 1 300 | (289) | 59 | (230) | (0,01) |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 2 900 | 26 | 23 | 49 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/12/2031 | 2 000 | (84) | 67 | (17) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement qatari | 1,000 | 20/12/2028 | 60 850 | 1 130 | 368 | 1 498 | 0,04 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2025 | 9 600 | (526) | 564 | 38 | 0,00 |
| BPS | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2027 | 2 500 | (171) | 175 | 4 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2024 | 5 400 | 6 | 44 | 50 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2026 | 6 800 | 39 | 112 | 151 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2027 | 10 000 | (182) | 414 | 232 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement chinois | 1,000 | 20/12/2028 | 74 700 | 895 | 491 | 1 386 | 0,04 |
| | Obligation internationale du gouvernement égyptien | 1,000 | 20/06/2024 | 1 000 | (93) | 65 | (28) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement égyptien | 1,000 | 20/12/2024 | 200 | (24) | 10 | (14) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2028 | 63 500 | 0 | 860 | 860 | 0,02 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 3 900 | (6) | 24 | 18 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 12 000 | 65 | 37 | 102 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2026 | 4 900 | 6 | 73 | 79 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 32 100 | 116 | 422 | 538 | 0,02 |
| | Obligation internationale du gouvernement serbe | 1,000 | 20/12/2027 | 1 800 | (160) | 117 | (43) | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2024 | 4 500 | 12 | 10 | 22 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2028 | 400 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2028 | 3 200 | 24 | 31 | 55 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/12/2024 | 15 687 | (277) | 405 | 128 | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2026 | 5 000 | (237) | 285 | 48 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2024 | 3 300 | 8 | 23 | 31 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement chinois | 1,000 | 20/12/2028 | 4 100 | 20 | 56 | 76 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2026 | 6 000 | 11 | 86 | 97 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2028 | 7 100 | (8) | 74 | 66 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement panaméen | 1,000 | 20/06/2024 | 3 400 | 6 | 5 | 11 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement panaméen | 1,000 | 20/12/2024 | 5 900 | 0 | 28 | 28 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 2 200 | 19 | 18 | 37 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2024 | 50 000 | 429 | (209) | 220 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/12/2024 | 1 200 | (41) | 51 | 10 | 0,00 |
| DUB | Eskom Holdings SOC Ltd. | 4,650 | 30/06/2029 | 16 000 | 0 | 1 389 | 1 389 | 0,04 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2024 | 10 000 | (131) | 167 | 36 | 0,00 |
| GLM | Obligation internationale du gouvernement nigérian | 1,000 | 20/12/2028 | 1 250 | (270) | 49 | (221) | (0,01) |

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--|--|--|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|------|
| GST | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 600 | \$ (32) | \$ 38 | \$ 6 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2026 | 3 600 | 33 | 47 | 80 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2028 | 9 300 | 18 | 202 | 220 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 100 | (1) | 2 | 1 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2028 | 700 | (7) | 11 | 4 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement panaméen | 1,000 | 20/12/2024 | 15 000 | 73 | (1) | 72 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement panaméen | 1,000 | 20/12/2025 | 10 000 | 22 | 10 | 32 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 29 100 | 118 | 370 | 488 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement philippin | 1,000 | 20/12/2028 | 12 200 | 52 | 158 | 210 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2028 | 4 200 | 38 | 34 | 72 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2024 | 3 000 | 29 | (16) | 13 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/12/2024 | 3 413 | 36 | (8) | 28 | 0,00 | |
| | HUS | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| | | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2024 | 9 700 | 103 | (60) | 43 | 0,00 |
| | JPM | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | 9 800 | (220) | 216 | (4) | 0,00 |
| | | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2026 | 7 700 | 41 | 130 | 171 | 0,01 |
| | | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2027 | 10 000 | (178) | 410 | 232 | 0,01 |
| Obligation internationale du gouvernement nigérian | | 1,000 | 20/12/2024 | 5 950 | (244) | 169 | (75) | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement nigérian | | 1,000 | 20/12/2028 | 5 000 | (1 158) | 273 | (885) | (0,02) | |
| Obligation internationale du gouvernement nigérian | | 5,000 | 20/06/2024 | 10 000 | 38 | 82 | 120 | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen | | 1,000 | 20/12/2024 | 10 000 | 47 | 1 | 48 | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | 1,000 | 20/06/2026 | 1 500 | 13 | 12 | 25 | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement polonais | | 1,000 | 20/06/2028 | 1 300 | (3) | 25 | 22 | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien | | 1,000 | 20/06/2024 | 11 100 | 140 | (91) | 49 | 0,00 | |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2027 | 9 100 | (564) | 615 | 51 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement égyptien | 1,000 | 20/06/2024 | 1 000 | (87) | 59 | (28) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2028 | 8 400 | 2 | 112 | 114 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 1 500 | (1) | 8 | 7 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 4 100 | (15) | 50 | 35 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2027 | 200 | (1) | 4 | 3 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2028 | 500 | (10) | 15 | 5 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement nigérian | 1,000 | 20/12/2028 | 5 000 | (1 139) | 253 | (886) | (0,02) | |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 37 300 | 105 | 521 | 626 | 0,02 | |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/12/2026 | 3 000 | (10) | 65 | 55 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement qatari | 1,000 | 20/12/2026 | 5 300 | 77 | 26 | 103 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement qatari | 1,000 | 20/12/2028 | 5 700 | 86 | 54 | 140 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2024 | 18 000 | 98 | (19) | 79 | 0,00 | |
| | MYI | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 2 700 | 23 | 22 | 45 | 0,00 |
| | | | | | \$ (2 323) | \$10 678 | \$8 355 | 0,22 | |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--------|
| AZD | 01/2024 | \$ | 2 051 AUD | 3 097 | \$ 63 | \$ 0 | 63 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 8 813 | \$ 1 223 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | CAD | 1 417 | 1 046 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 01/2024 | COP | 228 201 723 | 56 735 | 0 | (2 101) | (2 101) | (0,06) |
| | 01/2024 | DOP | 142 697 | 2 493 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 728 | 925 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 236 678 | 651 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN | 13 560 | 3 654 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN | 5 625 | 1 353 | 0 | (77) | (77) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 59 661 | COP 228 201 723 | 0 | (823) | (823) | (0,02) |
| | 01/2024 | | 4 367 | HUF 1 614 506 | 286 | 0 | 286 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 2 477 | ¥ 365 529 | 117 | 0 | 117 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 614 | NOK 6 530 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 729 | PLN 15 274 | 154 | 0 | 154 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 756 | TRY 52 056 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 02/2024 | DOP | 399 889 | \$ 6 926 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 6 | CNY 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 12 404 | \$ 1 713 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 03/2024 | COP | 228 201 723 | 58 800 | 790 | 0 | 790 | 0,02 |
| | 03/2024 | EGP | 50 687 | 1 448 | 284 | 0 | 284 | 0,01 |
| | 03/2024 | IDR | 21 051 063 | 1 334 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| 03/2024 | \$ | 301 | INR 25 155 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| 03/2024 | | 14 | PHP 796 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 04/2024 | MYR | 20 480 | \$ 4 475 | \$ 0 | \$ (22) | \$ (22) | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ | 1 262 | EGP 50 112 | 0 | (139) | (139) | 0,00 |
| BPS | 04/2024 | | 4 465 | MYR 20 596 | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 980 | \$ 721 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 49 768 | 54 351 | 4 | (641) | (637) | (0,02) |
| | 01/2024 | £ | 2 776 | 3 521 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 5 092 251 | 14 502 | 0 | (213) | (213) | (0,01) |
| | 01/2024 | IDR | 117 148 900 | 7 580 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 2 280 000 | 16 163 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN | 688 | 185 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN | 25 025 | 5 878 | 0 | (484) | (484) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 7 378 | AUD 10 960 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 019 | BRL 19 766 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 435 | CAD 1 945 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 63 637 | € 57 792 | 251 | (33) | 218 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 1 677 | HUF 594 996 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 014 | IDR 15 655 050 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 809 | ¥ 409 400 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 314 | PLN 5 674 | 129 | 0 | 129 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 265 390 | \$ 14 316 | 0 | (177) | (177) | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP | 22 149 | 633 | 113 | 0 | 113 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 37 726 | 1 186 | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 262 | EGP 9 414 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP | 2 273 328 | \$ 2 626 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 8 584 | 1 193 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 53 081 818 | 3 405 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 12 538 | 3 376 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB | 77 328 | 2 199 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 3 382 | IDR 53 145 084 | 64 | 0 | 64 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 2 663 | ILS 9 639 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 045 | INR 87 374 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 2 204 | PEN 8 301 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 750 | THB 25 911 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 06/2024 | | 102 | £ 81 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BRC | 06/2024 | | 2 676 | KRW 3 441 788 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 245 386 | \$ 269 871 | 0 | (1 257) | (1 257) | (0,03) |
| | 01/2024 | NZD | 9 123 | 5 612 | 0 | (164) | (164) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN | 14 785 | 3 381 | 0 | (378) | (378) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 1 378 | AUD 2 095 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 072 | HUF 381 469 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 8 225 | TRY 246 649 | 53 | (10) | 43 | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP | 109 243 | \$ 3 123 | 555 | 0 | 555 | 0,01 |
| | 02/2024 | \$ | 2 122 | TRY 64 694 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 6 031 | 189 470 | 10 | (45) | (35) | 0,00 |
| | 04/2024 | | 13 765 | 440 765 | 0 | (181) | (181) | 0,00 |
| | 06/2024 | £ | 5 790 | \$ 7 284 | 0 | (100) | (100) | 0,00 |
| BSH | 02/2024 | ¥ | 7 320 000 | 52 140 | 0 | (158) | (158) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL | 43 245 | 8 882 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 2 002 | 1 500 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | CLP | 10 186 369 | 11 488 | 0 | (175) | (175) | 0,00 |
| | 01/2024 | COP | 20 000 000 | 4 886 | 0 | (247) | (247) | (0,01) |
| | 01/2024 | € | 1 419 | 1 542 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 232 | 294 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 909 915 | 2 557 | 4 | (74) | (70) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 729 388 | 40 843 | 0 | (2 035) | (2 035) | (0,05) |
| | 01/2024 | PLN | 9 702 | 2 294 | 0 | (173) | (173) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 302 | AUD 1 936 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 308 | BRL 16 285 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 5 208 | CAD 6 969 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 062 | CHF 1 796 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 11 599 | CLP 10 169 137 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 097 | € 1 014 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 17 360 | ¥ 2 451 100 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 8 695 | MXN 151 374 | 204 | 0 | 204 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 148 | NOK 1 579 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 5 730 | PLN 24 008 | 374 | 0 | 374 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 1 741 | SEK 18 225 | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 863 | ZAR 16 268 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 12 375 | \$ 672 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 2 165 | BRL 10 953 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 2 010 | EGP 72 647 | 0 | (303) | (303) | (0,01) |
| | 03/2024 | ILS | 6 779 | \$ 1 862 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | 1 180 000 | 8 419 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 34 641 | 9 199 | 0 | (134) | (134) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 11 488 | CLP 10 228 300 | 178 | 0 | 178 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 006 | IDR 15 600 344 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 6 766 | PEN 25 193 | 40 | (18) | 22 | 0,00 |
| | 04/2024 | | 8 882 | BRL 43 683 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 04/2024 | | 4 586 | TRY 154 052 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | NGN | 135 300 | \$ 220 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 444 | ZAR 27 412 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 1 861 | EGP 67 006 | 0 | (287) | (287) | (0,01) |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 03/2024 | CNH | 5 903 | \$ 819 | \$ 0 | \$ (15) | \$ (15) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 1 664 | SGD 2 203 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 04/2024 | EGP | 70 919 | \$ 1 861 | 271 | 0 | 271 | 0,01 |
| | 04/2024 | \$ | 1 573 | EGP 62 146 | 0 | (180) | (180) | (0,01) |
| GLM | 01/2024 | AUD | 4 142 | \$ 2 777 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 17 928 | \$ 13 220 | 0 | (378) | (378) | (0,01) |
| | 01/2024 | CHF | 7 894 | 9 008 | 0 | (376) | (376) | (0,01) |
| | 01/2024 | DOP | 1 447 741 | 25 378 | 558 | 0 | 558 | 0,01 |
| | 01/2024 | HUF | 726 758 | 2 004 | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 843 867 | 48 107 | 0 | (1 500) | (1 500) | (0,04) |
| | 01/2024 | NOK | 3 775 | 364 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 5 518 | HUF 1 999 083 | 243 | 0 | 243 | 0,01 |
| | 01/2024 | 2 155 | MXN 37 281 | 37 | 0 | 37 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 8 563 | PLN 33 915 | 60 | 0 | 60 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 703 | TRY 21 370 | 11 | 0 | 11 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 1 058 | ZAR 20 062 | 38 | 0 | 38 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 959 411 | \$ 51 340 | 0 | (1 040) | (1 040) | (0,03) |
| | 02/2024 | \$ | 46 | EGP 1 665 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 3 838 | \$ 532 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 03/2024 | DOP | 167 242 | 2 924 | 63 | 0 | 63 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 2 283 | PEN 8 484 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | 564 | TRY 17 707 | 0 | (6) | (6) | 0,00 | |
| | 04/2024 | DOP | 160 100 | \$ 2 784 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ | 2 442 | EGP 96 337 | 0 | (282) | (282) | (0,01) |
| JPM | 01/2024 | HUF | 6 615 722 | \$ 18 831 | 0 | (287) | (287) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 744 | BRL 3 675 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 01/2024 | 258 | MXN 4 802 | 24 | 0 | 24 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 81 | NGN 66 987 | 0 | (15) | (15) | 0,00 | |
| | 01/2024 | 3 986 | TRY 118 303 | 0 | (11) | (11) | 0,00 | |
| | 02/2024 | EGP | 55 500 | \$ 1 593 | 289 | 0 | 289 | 0,01 |
| | 02/2024 | \$ | 8 652 | BRL 42 436 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 02/2024 | 1 000 | EGP 36 046 | 0 | (153) | (153) | 0,00 | |
| | 02/2024 | 10 529 | INR 879 612 | 17 | 0 | 17 | 0,00 | |
| | 02/2024 | 2 946 | TRY 89 936 | 0 | (16) | (16) | 0,00 | |
| | 03/2024 | AED | 37 511 | \$ 10 221 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP | 2 744 025 | 3 043 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 21 657 544 | 1 396 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB | 64 518 | 1 815 | 0 | (88) | (88) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 19 460 | 626 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 1 037 | IDR 16 011 487 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 313 | INR 26 188 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 04/2024 | 709 | EGP 27 991 | 0 | (81) | (81) | 0,00 | |
| MBC | 06/2024 | KRW | 602 380 | \$ 461 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD | 1 667 | 1 129 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 37 460 | 40 868 | 0 | (522) | (522) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF | 2 102 208 | 5 670 | 0 | (388) | (388) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ | 520 000 | 3 643 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 963 | AUD 1 453 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 595 | CAD 6 234 | 133 | 0 | 133 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 1 748 | £ 1 388 | 21 | 0 | 21 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 690 | HUF 242 371 | 9 | 0 | 9 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 1 887 | ¥ 269 000 | 22 | 0 | 22 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 1 043 | NOK 11 305 | 71 | 0 | 71 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 144 060 | \$ 7 538 | 0 | (330) | (330) | (0,01) |
| | 02/2024 | ¥ | 1 060 000 | 7 467 | 0 | (98) | (98) | 0,00 |
| | 03/2024 | PHP | 136 267 | 2 435 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 56 481 | 1 814 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 3 088 | CNH 21 851 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | 3 361 | INR 280 000 | 0 | (8) | (8) | 0,00 | |
| | 04/2024 | 4 551 | EGP 182 950 | 0 | (449) | (449) | (0,01) | |
| MYI | 01/2024 | AUD | 18 | \$ 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 318 | 353 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 50 | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 1 290 164 | 3 667 | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR | 4 927 | 1 056 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 01/2024 | NGN | 322 875 | 525 | 205 | 0 | 205 | 0,01 |
| | 01/2024 | PLN | 9 528 | 2 310 | 0 | (112) | (112) | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD | 283 | 215 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 786 | £ 1 415 | 20 | (1) | 19 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 390 | HUF 490 251 | 23 | 0 | 23 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 942 | ¥ 138 852 | 44 | 0 | 44 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 135 | SGD 178 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 3 673 | ZAR 67 686 | 23 | 0 | 23 | 0,00 | |
| | 02/2024 | EGP | 29 660 | \$ 847 | 151 | 0 | 151 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 11 | CNY 80 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 25 | EGP 905 | 0 | (4) | (4) | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 8 410 | \$ 1 166 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 27 010 172 | 1 755 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | THB | 26 336 | 761 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 582 | EGP 20 855 | 0 | (103) | (103) | 0,00 |
| | 04/2024 | EGP | 59 622 | \$ 1 562 | 225 | 0 | 225 | 0,01 |
| | 04/2024 | \$ | 3 020 | EGP 120 817 | 0 | (311) | (311) | (0,01) |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 06/2024 | KRW | 209 363 | \$ 161 | \$ 0 | \$ (2) | 0,00 | |
| | 06/2024 | \$ | 7 167 | £ 5 709 | 114 | 0 | 0,00 | |
| RBC | 04/2024 | MXN | 1 229 | \$ 69 | 0 | (2) | 0,00 | |
| RYL | 01/2024 | AUD | 2 612 | £ 1 756 | 0 | (27) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 479 | £ 1 156 | 0 | (5) | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | € | 18 | \$ 20 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 1 279 000 | 8 897 | 0 | (181) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 88 | € 79 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 149 | MYR 698 | 3 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 557 | NGN 457 854 | 0 | (104) | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 783 | TRY 23 176 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 02/2024 | MYR | 11 150 | \$ 2 437 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 801 | EGP 28 824 | 0 | (123) | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 2 413 | MYR 11 177 | 30 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 8 257 | \$ 1 140 | 0 | (26) | 0,00 | |
| | 03/2024 | THB | 92 277 | 2 670 | 0 | (52) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 853 | EGP 30 605 | 0 | (150) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 7 761 | IDR 120 023 865 | 22 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 682 | INR 57 015 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 3 000 | EGP 118 215 | 0 | (350) | (0,01) | |
| SSB | 01/2024 | CLP | 10 916 650 | \$ 12 349 | 0 | (142) | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 26 871 161 | 1 731 | 0 | (11) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 688 | IDR 10 714 513 | 7 | 0 | 0,00 | |
| TOR | 01/2024 | | 1 557 | ¥ 228 343 | 64 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 3 993 | \$ 553 | 0 | (11) | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | £ | 16 023 | 20 269 | 0 | (158) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 1 641 | 5 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 779 | AUD 1 175 | 22 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 719 | BRL 3 543 | 10 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 6 556 | IDR 101 444 549 | 30 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 3 405 | NOK 36 325 | 172 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 044 | NZD 1 697 | 30 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 140 | SEK 1 446 | 3 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 100 853 | \$ 5 283 | 0 | (224) | (0,01) | |
| | 03/2024 | CZK | 363 202 | 16 315 | 98 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 101 499 619 | 6 556 | 0 | (26) | 0,00 | |
| | 03/2024 | ¥ | 5 040 000 | 36 009 | 0 | (112) | 0,00 | |
| | | | | | \$ 8 519 | \$ (20 124) | \$ (11 605) | (0,30) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie M Détail en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 1 620 | AUD 2 443 | \$ 47 | \$ 0 | \$ 47 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 86 | 130 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD 16 | \$ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 49 | AUD 73 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 3 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 80 | 118 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 52 | 78 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 673 | 1 015 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | 3 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 780 | 1 176 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | | | | \$ 95 | \$ 0 | \$ 95 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ 4 277 | CHF 3 730 | \$ 158 | \$ 0 | \$ 158 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 25 313 | 22 054 | 904 | 0 | 904 | 0,02 |
| GLM | 01/2024 | 28 222 | 24 731 | 1 178 | 0 | 1 178 | 0,04 |
| MYI | 01/2024 | CHF 11 | \$ 13 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 28 368 | CHF 24 763 | 1 070 | 0 | 1 070 | 0,03 |
| | | | | \$ 3 310 | \$ (1) | \$ 3 309 | 0,09 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 18 529 | \$ 20 239 | \$ 1 | \$ (235) | \$ (234) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 539 487 | € 490 734 | 2 731 | (4) | 2 727 | 0,07 |
| BRC | 01/2024 | 449 859 | 409 045 | 2 096 | 0 | 2 096 | 0,06 |
| | 01/2024 | € 20 731 | \$ 22 535 | 10 | (381) | (371) | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | 78 | 85 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 400 182 | € 366 005 | 4 219 | 0 | 4 219 | 0,10 |
| | | | | \$ 9 057 | \$ (622) | \$ 8 435 | 0,21 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 284 | \$ 359 | \$ 0 | \$ (3) | \$ (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 229 | £ 3 338 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 14 | \$ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 386 | £ 2 670 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 55 | 43 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 237 | \$ 299 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | \$ 95 | £ 75 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 44 | \$ 56 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 214 | 273 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 17 | £ 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 84 | \$ 106 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 | £ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 19 415 | 15 349 | 153 | 0 | 153 | 0,01 |
| | 01/2024 | 11 885 | 9 419 | 123 | 0 | 123 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | £ 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 19 413 | £ 15 339 | 142 | 0 | 142 | 0,00 |
| | | | | \$ 463 | \$ (6) | \$ 457 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation et E en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| DUB | 01/2024 | \$ 8 020 | SGD 10 661 | \$ 64 | \$ 0 | \$ 64 | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD 157 | \$ 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ 248 | SGD 329 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 036 | 2 715 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD 635 | \$ 475 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 7 | SGD 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 02/2024 | SGD 182 | \$ 139 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 7 502 | SGD 10 007 | 87 | 0 | 87 | 0,01 |
| TOR | 02/2024 | 146 | 193 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 6 949 | 9 271 | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| UAG | 02/2024 | SGD 39 | \$ 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 45 | 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 258 | \$ (8) | \$ 250 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ 7 390 | 0,19 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| CERTIFICATS DE DÉPÔT | | | |
| Banco Davivienda S.A. | | | |
| 10,942 % éch. 28/04/2026 | COP 1 520 000 | \$ 396 | 0,01 |
| 11,679 % éch. 12/05/2025 | 20 903 700 | 5 369 | 0,14 |
| 12,950 % éch. 08/03/2026 | 15 954 589 | 4 283 | 0,11 |
| 13,183 % éch. 06/06/2026 | 13 699 000 | 3 725 | 0,10 |
| 13,455 % éch. 13/06/2025 | 8 845 000 | 2 353 | 0,06 |
| 13,456 % éch. 07/06/2025 | 17 680 000 | 4 705 | 0,12 |
| 13,456 % éch. 09/06/2025 | 5 906 000 | 1 572 | 0,04 |
| 13,501 % éch. 13/12/2024 | 15 106 000 | 3 984 | 0,10 |
| 15,389 % éch. 21/02/2024 | 4 622 500 | 1 207 | 0,03 |
| Bancolombia S.A. | | | |
| 5,917 % éch. 27/01/2024 | 21 517 000 | 5 555 | 0,15 |
| 10,388 % éch. 20/04/2026 | 29 093 800 | 7 506 | 0,20 |
| 13,320 % éch. 08/06/2025 | 7 817 000 | 2 055 | 0,05 |
| 13,456 % éch. 14/06/2025 | 14 569 000 | 3 867 | 0,10 |
| 13,637 % éch. 14/12/2024 | 20 654 000 | 5 408 | 0,14 |
| 16,137 % éch. 01/09/2024 | 8 476 000 | 2 245 | 0,06 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| BBVA Colombia S.A. | | | |
| 13,093 % éch. 28/04/2026 | COP 7 588 000 | \$ 2 069 | 0,06 |
| 13,229 % éch. 10/05/2026 | 3 293 000 | 901 | 0,02 |
| 13,365 % éch. 04/05/2026 | 4 790 000 | 1 287 | 0,03 |
| 14,460 % éch. 13/01/2024 | 9 047 900 | 2 327 | 0,06 |
| 16,412 % éch. 25/04/2024 | 334 000 | 86 | 0,00 |
| Total des Certificats de dépôt | | \$ 60 900 | 1,58 |
| Total des Investissements | | \$ 4 217 590 | 109,65 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (371 305) | (9,65) |
| Actifs nets | | \$ 3 846 285 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,89 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-----------------|------------------|------------------|------------------------|
| Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071 | 10/06/2022 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » | 10/06/2022 | 460 | 460 | 0,01 |
| Development Bank of Southern Africa 8,600 % éch. 21/10/2024 | 07/10/2021 | 31 381 | 25 473 | 0,66 |
| DrillCo Holding Lux S.A. | 08/06/2023 | 7 281 | 9 040 | 0,24 |
| | | \$ 39 122 | \$ 34 973 | 0,91 |

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 422 139 \$ (31 décembre 2022 : 84 485 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 842 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 4 698 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 3 381 \$ (31 décembre 2022 : 3 002 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 27 700 \$ (31 décembre 2022 : 36 243 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 4 980 \$ (31 décembre 2022 : 11 680 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 1 | \$ 3 834 962 | \$ 99 009 | \$ 3 933 972 |
| Fonds d'investissement | 192 346 | 0 | 0 | 192 346 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 2 599 | 0 | 2 599 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (1 938) | 28 322 | 1 389 | 27 773 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 60 900 | 0 | 60 900 |
| Totaux | \$ 190 409 | \$ 3 926 783 | \$ 100 398 | \$ 4 217 590 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 1 | \$ 3 210 349 | \$ 57 311 | \$ 3 267 661 |
| Fonds d'investissement | 52 797 | 0 | 0 | 52 797 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 9 160 | 0 | 9 160 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 5 730 | 14 061 | 25 | 19 766 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 2 227 | 2 227 |
| Totaux | \$ 58 528 | \$ 3 233 570 | \$ 59 513 | \$ 3 351 611 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 4,050 % | 27/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (38 488) | \$ (42 540) | (1,11) |
| | 4,500 | 22/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (714) | (717) | (0,02) |
| | 5,540 | 19/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (21 425) | (21 468) | (0,56) |
| | 5,680 | 19/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (17 119) | (17 154) | (0,45) |
| | 5,690 | 19/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (23 158) | (23 206) | (0,60) |
| | 5,990 | 18/07/2023 | 16/01/2024 | (16 646) | (17 108) | (0,45) |
| BRC | 4,000 | 02/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (7 423) | (7 473) | (0,19) |
| BSN | 5,510 | 19/12/2023 | 04/01/2024 | (180 465) | (180 824) | (4,70) |
| MYI | 3,750 | 01/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (751) | (756) | (0,02) |
| | 4,000 | 13/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (4 389) | (4 413) | (0,11) |
| NOM | 5,250 | 13/10/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (421) | (426) | (0,01) |
| | 5,450 | 05/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (9 554) | (9 554) | (0,25) |
| SCX | 4,080 | 20/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (37 848) | (42 005) | (1,09) |
| | 5,560 | 17/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (25 689) | (25 868) | (0,67) |
| | 5,580 | 17/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (9 151) | (9 215) | (0,24) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (402 727) | (10,47) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 88 | \$ 0 | \$ 88 | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 |
| BOA | (1 075) | 1 740 | 665 | (9 485) | 8 490 | (995) |
| BPS | 4 872 | (7 810) | (2 938) | 1 829 | (690) | 1 139 |
| BRC | 1 009 | (1 900) | (891) | (897) | 860 | (37) |
| BSH | (158) | 0 | (158) | S/O | S/O | S/O |
| CBK | (696) | 1 140 | 444 | 20 215 | (19 290) | 925 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (454) | 0 | (454) |
| DUB | 1 429 | (1 270) | 159 | 126 | (230) | (104) |
| FAR | 0 | (290) | (290) | S/O | S/O | S/O |
| FBF | S/O | S/O | S/O | (33) | 0 | (33) |
| GLM | (1 718) | 940 | (778) | 46 | (120) | (74) |
| GST | 705 | (690) | 15 | (1 298) | 1 330 | 32 |
| HUS | 13 | (150) | (137) | 58 | (150) | (92) |
| IND | S/O | S/O | S/O | 0 | 270 | 270 |
| JPM | (659) | 620 | (39) | 1 107 | (1 310) | (203) |
| MBC | 2 577 | (4 680) | (2 103) | 3 472 | (2 910) | 562 |
| MYC | 180 | (380) | (200) | (27) | (60) | (87) |
| MYI | 1 515 | (1 480) | 35 | 70 | (160) | (90) |
| RBC | (2) | 0 | (2) | 1 | 0 | 1 |
| RYL | (32) | 0 | (32) | 1 375 | (1 300) | 75 |
| SCX | (779) | 540 | (239) | 8 586 | (8 150) | 436 |
| SOG | S/O | S/O | S/O | (37) | 0 | (37) |
| SSB | (23) | 0 | (23) | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 135 | 0 | 135 | 8 | (20) | (12) |
| UAG | 9 | 0 | 9 | (678) | 730 | 52 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 91,76 | 83,54 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 10,19 | 15,12 |
| Autres valeurs mobilières | 0,33 | 0,17 |
| Fonds d'investissement | 5,00 | 1,60 |
| Contrats de mise en pension | 0,07 | 0,28 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,37 | 0,01 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,16 | (0,14) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,19 | 0,73 |
| Certificats de dépôt | 1,58 | 0,07 |
| Contrats de prise en pension | (10,47) | (2,28) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Albanie | S/O | 0,09 |
| Angola | 1,02 | 0,19 |
| Argentine | 2,00 | 1,46 |
| Azerbaïdjan | 1,11 | 1,31 |
| Bahamas | S/O | 0,36 |
| Bahreïn | 0,29 | 0,36 |
| Biélorussie | S/O | 0,02 |
| Bénin | S/O | 0,18 |
| Brésil | 2,00 | 2,04 |
| Bulgarie | 0,27 | S/O |
| Cameroun | 0,29 | 0,18 |
| Canada | 0,03 | S/O |
| Îles Caïmans | 3,24 | 3,52 |
| Chili | 2,72 | 2,67 |
| Chine | 0,03 | 0,32 |
| Colombie | 2,27 | 2,78 |
| Costa Rica | 0,25 | 0,27 |
| République dominicaine | 3,67 | 2,69 |
| Équateur | 1,10 | 1,11 |
| Égypte | 2,20 | 2,10 |
| Salvador | 0,44 | 0,28 |
| Éthiopie | S/O | 0,06 |
| Gabon | 0,02 | S/O |
| Géorgie | 0,01 | 0,01 |
| Allemagne | S/O | 0,33 |
| Ghana | 0,57 | 0,74 |
| Guatemala | 0,78 | 0,68 |
| Hong Kong | 1,02 | 0,83 |
| Hongrie | 1,82 | 0,96 |
| Inde | 0,23 | 0,30 |
| Indonésie | 3,74 | 4,75 |
| Internationales | 0,21 | S/O |
| Irak | 0,08 | S/O |
| Irlande | 0,66 | 0,73 |
| Israël | 1,73 | 1,74 |
| Côte d'Ivoire | 0,24 | 0,67 |
| Jamaïque | 0,07 | 0,08 |
| Japon | 0,43 | 0,50 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,65 | 0,71 |
| Jordanie | 0,30 | 0,72 |
| Kazakhstan | 1,03 | 1,37 |
| Kenya | 0,22 | 0,03 |
| Liban | 0,02 | 0,02 |
| Luxembourg | 1,79 | 0,45 |
| Macédoine du Nord | 0,23 | S/O |
| Malaisie | 0,65 | 0,33 |
| Île Maurice | S/O | 0,08 |
| Mexique | 8,34 | 6,66 |
| Mongolie | 0,03 | 0,05 |
| Maroc | 0,54 | 0,51 |
| Multinationales | 0,25 | 0,28 |
| Namibie | 0,15 | 0,17 |
| Pays-Bas | 0,31 | 0,61 |
| Nigeria | 1,32 | 1,62 |
| Oman | 1,46 | 1,73 |
| Pakistan | 0,85 | 0,34 |
| Panama | 1,79 | 1,59 |
| Paraguay | 0,40 | 0,35 |
| Pérou | 1,22 | 1,17 |
| Philippines | 0,53 | 0,42 |
| Pologne | 1,11 | 0,38 |
| Qatar | 2,51 | 1,66 |
| Roumanie | 1,58 | 1,80 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Russie | 0,01 | 0,22 |
| Arabie saoudite | 3,19 | 2,32 |
| Sénégal | 0,63 | 0,23 |
| Serbie | 1,23 | 0,69 |
| Singapour | 0,22 | 0,50 |
| Slovénie | 0,33 | S/O |
| Afrique du Sud | 4,48 | 4,48 |
| Corée du Sud | 0,85 | S/O |
| Espagne | 0,35 | 0,41 |
| Sri Lanka | 0,72 | 0,50 |
| Supranationales | 0,18 | 0,21 |
| Suisse | 0,30 | 0,82 |
| Tanzanie | 1,02 | 0,50 |
| Thaïlande | 0,06 | 0,10 |
| Trinité-et-Tobago | 0,16 | S/O |
| Tunisie | 0,66 | 0,28 |
| Turquie | 5,34 | 5,16 |
| Ukraine | 0,46 | 0,27 |
| Émirats arabes unis | 2,55 | 1,89 |
| Royaume-Uni | 1,15 | 2,07 |
| États-Unis | 10,62 | 9,86 |
| Ouzbékistan | 0,37 | 0,21 |
| Venezuela | 0,69 | 0,40 |
| Vietnam | 0,01 | 0,02 |
| Îles Vierges britanniques | 0,12 | 0,64 |
| Zambie | 0,01 | 0,11 |
| Instruments à court terme | 4,75 | 9,58 |
| Fonds d'investissement | 5,00 | 1,60 |
| Contrats de mise en pension | 0,07 | 0,28 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,37 | 0,01 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | (0,02) |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,16 | (0,12) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Options de change | 0,00 | S/O |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,05) | 0,08 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,22 | (0,11) |
| Swaps de volatilité | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,30) | (0,14) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,32 | 0,90 |
| Certificats de dépôt | 1,58 | 0,07 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (9,65) | (1,38) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | BULGARIE | | | | CHILI | | | |
| ARGENTINE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement argentin | | | | Obligation internationale du gouvernement bulgare | | | | Xiaomi Best Time International Ltd. | | | |
| 0,750 % éch. 09/07/2030 | \$ 13 162 | \$ 5 287 | 0,20 | 4,375 % éch. 13/05/2031 | € 2 850 | \$ 3 315 | 0,12 | 4,100 % éch. 14/07/2051 | 10 500 | 7 477 | 0,28 |
| 1,000 % éch. 09/07/2029 | 6 194 | 2 473 | 0,09 | 4,500 % éch. 27/01/2033 | 5 400 | 6 281 | 0,24 | Zhongsheng Group Holdings Ltd. | | | |
| 3,500 % éch. 09/07/2041 | 104 129 | 35 572 | 1,32 | 4,875 % éch. 13/05/2036 | 3 900 | 4 626 | 0,17 | 3,000 % éch. 13/01/2026 | 1 000 | 933 | 0,03 |
| 3,625 % éch. 09/07/2035 | 11 079 | 3 778 | 0,14 | | | | | | | | |
| 4,250 % éch. 09/01/2038 | 16 013 | 6 366 | 0,23 | Total Bulgarie | | 14 222 | 0,53 | | | 62 465 | 2,32 |
| Provincia de Buenos Aires | | | | ÎLES CAÏMANS | | | | CHILI | | | |
| 6,375 % éch. 01/09/2037 | 7 000 | 2 698 | 0,10 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Provincia de la Rioja | | | | Betony CLO Ltd. | | | | Corp. Nacional del Cobre de Chile | | | |
| 6,500 % éch. 24/02/2028 | 425 | 247 | 0,01 | 6,732 % éch. 30/04/2031 | | | | 3,150 % éch. 14/01/2030 | | | |
| Provincia de Neuquen | | | | Dryden Senior Loan Fund | | | | 3,625 % éch. 01/08/2027 | | | |
| 6,750 % éch. 27/04/2030 | 320 | 276 | 0,01 | 6,852 % éch. 15/08/2030 | | | | 3,700 % éch. 30/01/2050 | | | |
| Total Argentine | | 56 697 | 2,10 | Golub Capital Partners CLO 26B Ltd. | | | | 4,375 % éch. 05/02/2049 | | | |
| ARMÉNIE | | | | ÎLES CAÏMANS | | | | CHILI | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de la République d'Arménie | | | | Madison Park Funding Ltd. | | | | Empresa de los Ferrocarriles del Estado | | | |
| 3,600 % éch. 02/02/2031 | 7 100 | 5 824 | 0,22 | 6,608 % éch. 19/04/2030 | | | | 3,068 % éch. 18/08/2050 | | | |
| 3,950 % éch. 26/09/2029 | 800 | 699 | 0,02 | Northwoods Capital Ltd. | | | | 3,830 % éch. 14/09/2061 | | | |
| Total Arménie | | 6 523 | 0,24 | 7,246 % éch. 15/08/2031 | | | | Sociedad Química y Minera de Chile S.A. | | | |
| BAHAMAS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | | CHILI | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement des Bahamas | | | | Sunac China Holdings Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement chilien | | | |
| 9,000 % éch. 16/06/2029 | 4 400 | 4 279 | 0,16 | 1,000 % éch. 30/09/2032 | | | | 2,550 % éch. 27/01/2032 (g) | | | |
| BAHREÏN | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | CHILI | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement bahreïni | | | | AAC Technologies Holdings, Inc. | | | | 3,100 % éch. 07/05/2041 | | | |
| 4,250 % éch. 25/01/2028 | 14 500 | 13 711 | 0,51 | 2,625 % éch. 02/06/2026 | | | | 3,100 % éch. 22/01/2061 | | | |
| 5,250 % éch. 25/01/2033 | 3 000 | 2 678 | 0,10 | Adib Sukuk Co. Ltd. | | | | 3,240 % éch. 06/02/2028 | | | |
| 5,625 % éch. 30/09/2031 | 9 200 | 8 672 | 0,32 | 5,695 % éch. 15/11/2028 | | | | 3,250 % éch. 21/09/2071 | | | |
| 6,000 % éch. 19/09/2044 | 1 300 | 1 072 | 0,04 | Alibaba Group Holding Ltd. | | | | 3,500 % éch. 25/01/2050 | | | |
| Total Bahreïn | | 26 133 | 0,97 | 2,700 % éch. 09/02/2041 | | | | 3,500 % éch. 15/04/2053 (g) | | | |
| BÉNIN | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | CHILI | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement du Bénin | | | | Baidu, Inc. | | | | 4,340 % éch. 07/03/2042 | | | |
| 4,875 % éch. 19/01/2032 | € 3 000 | 2 716 | 0,10 | 2,375 % éch. 23/08/2031 | | | | Total Chili | | | |
| 4,950 % éch. 22/01/2035 | 15 100 | 13 183 | 0,49 | Biocanico Sovereign Certificate Ltd. | | | | 82 606 | | | |
| Total Bénin | | 15 899 | 0,59 | 0,000 % éch. 05/06/2034 (a) | | | | CHINE | | | |
| BERMUDES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Star Energy Geothermal Darajat | | | | CIFI Holdings Group Co. Ltd. | | | | Yango Justice International Ltd. | | | |
| 4,850 % éch. 14/10/2038 | \$ 3 800 | 3 485 | 0,13 | 4,450 % éch. 17/08/2026 ^ | | | | 7,500 % éch. 17/02/2025 ^ | | | |
| BRÉSIL | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | CHINE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais | | | | Country Garden Holdings Co. Ltd. | | | | 7,875 % éch. 04/09/2024 ^ | | | |
| 5,333 % éch. 15/02/2028 | 11 305 | 11 139 | 0,42 | 2,700 % éch. 12/07/2026 ^ | | | | Total Chine | | | |
| CSN Inova Ventures | | | | 3,875 % éch. 22/10/2030 ^ | | | | 44 | | | |
| 6,750 % éch. 28/01/2028 | 8 300 | 8 116 | 0,30 | Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd. | | | | COLOMBIE | | | |
| Rede D'or Finance SARL | | | | 2,250 % éch. 15/07/2031 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 4,500 % éch. 22/01/2030 | 263 | 239 | 0,01 | ICD Funding Ltd. | | | | Banco Davivienda S.A. | | | |
| Suzano Austria GmbH | | | | 3,223 % éch. 28/04/2026 | | | | 6,650 % éch. 22/04/2031 | | | |
| 3,125 % éch. 15/01/2032 | 3 000 | 2 492 | 0,09 | IHS Holding Ltd. | | | | (d)(e) | | | |
| | | 21 986 | 0,82 | 5,625 % éch. 29/11/2026 | | | | 6 720 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | Interoceánica Finance Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement colombien | | | |
| 4,750 % éch. 14/01/2050 | 20 475 | 15 819 | 0,58 | 0,000 % éch. 30/11/2025 (a) | | | | 3,000 % éch. 30/01/2030 | | | |
| 5,000 % éch. 27/01/2045 | 8 495 | 6 957 | 0,26 | 0,000 % éch. 15/05/2030 (a) | | | | 3,125 % éch. 15/04/2031 | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 | 19 200 | 19 951 | 0,74 | 7,860 % éch. 15/05/2030 | | | | 3,875 % éch. 25/04/2027 | | | |
| | | 42 727 | 1,58 | Kaisa Group Holdings Ltd. | | | | 3,875 % éch. 15/02/2061 | | | |
| Total Brésil | | 64 713 | 2,40 | 9,375 % éch. 30/06/2024 ^ | | | | 4,125 % éch. 15/05/2051 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | Lima Metro Line Finance Ltd. | | | | 4,500 % éch. 28/01/2026 | | | |
| 4,750 % éch. 14/01/2050 | 20 475 | 15 819 | 0,58 | 5,875 % éch. 05/07/2034 | | | | 5,000 % éch. 15/06/2045 | | | |
| 5,000 % éch. 27/01/2045 | 8 495 | 6 957 | 0,26 | MAF Sukuk Ltd. | | | | 5,200 % éch. 15/05/2049 | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 | 19 200 | 19 951 | 0,74 | 4,638 % éch. 14/05/2029 | | | | 5,625 % éch. 26/02/2044 | | | |
| | | 42 727 | 1,58 | Powerlong Real Estate Holdings Ltd. | | | | 6,125 % éch. 18/01/2041 | | | |
| Total Brésil | | 64 713 | 2,40 | 5,950 % éch. 30/04/2025 ^ | | | | 7,375 % éch. 18/09/2037 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | Sunac China Holdings Ltd. | | | | 7,500 % éch. 02/02/2034 | | | |
| 4,750 % éch. 14/01/2050 | 20 475 | 15 819 | 0,58 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | | | | 7,500 % éch. 20/04/2033 | | | |
| 5,000 % éch. 27/01/2045 | 8 495 | 6 957 | 0,26 | 6,250 % éch. 30/09/2027 | | | | 8,000 % éch. 14/11/2035 | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 | 19 200 | 19 951 | 0,74 | 6,500 % éch. 30/09/2027 | | | | 8,750 % éch. 14/11/2053 | | | |
| | | 42 727 | 1,58 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | | | | 10,375 % éch. 28/01/2033 | | | |
| Total Brésil | | 64 713 | 2,40 | 7,000 % éch. 30/09/2029 | | | | 1 350 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | Total Colombie | | | | 85 492 | | | |
| 4,750 % éch. 14/01/2050 | 20 475 | 15 819 | 0,58 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | | | | 3,17 | | | |
| 5,000 % éch. 27/01/2045 | 8 495 | 6 957 | 0,26 | 6,250 % éch. 30/09/2027 | | | | | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 | 19 200 | 19 951 | 0,74 | 6,500 % éch. 30/09/2027 | | | | | | | |
| | | 42 727 | 1,58 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | | | | | | | |
| Total Brésil | | 64 713 | 2,40 | 7,000 % éch. 30/09/2029 | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | Total Colombie | | | | 85 492 | | | |
| 4,750 % éch. 14/01/2050 | 20 475 | 15 819 | 0,58 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | | | | 3,17 | | | |
| 5,000 % éch. 27/01/2045 | 8 495 | 6 957 | 0,26 | 6,250 % éch. 30/09/2027 | | | | | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 | 19 200 | 19 951 | 0,74 | 6,500 % éch. 30/09/2027 | | | | | | | |
| | | 42 727 | 1,58 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | | | | | | | |
| Total Brésil | | 64 713 | 2,40 | 7,000 % éch. 30/09/2029 | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | Total Colombie | | | | 85 492 | | | |
| 4,750 % éch. 14/01/2050 | 20 475 | 15 819 | 0,58 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | | | | 3,17 | | | |
| 5,000 % éch. 27/01/2045 | 8 495 | 6 957 | 0,26 | 6,250 % éch. 30/09/2027 | | | | | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 | 19 200 | 19 951 | 0,74 | 6,500 % éch. 30/09/2027 | | | | | | | |
| | | 42 727 | 1,58 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | | | | | | | |
| Total Brésil | | 64 713 | 2,40 | 7,000 % éch. 30/09/2029 | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien | | | | Total Colombie | | | | 85 492 | | | |
| 4,750 % éch. 14/01/2050 | 20 475 | 15 819 | 0,58 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | | | | 3,17 | | | |
| 5,000 % éch. 27/01/2045 | 8 495 | 6 957 | 0,26 | 6,250 % éch. 30/09/2027 | | | | | | | |
| 6,250 % éch. 18/03/2031 | 19 200 | 19 951 | 0,74 | 6,500 % éch. 30/09/2027 | | | | | | | |
| | | 42 727 | 1,58 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | | | | | | | |
| Total Brésil | | 64 713 | 2,40 | 7,000 % éch. 30/09/2029 | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|----------|--------|------|
| COSTA RICA | | | | SALVADOR | | | | HONGRIE | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement costaricain | | | | Obligation internationale du gouvernement salvadorien | | | | MVM Energetika Zrt | | | | | | |
| 5,625 % éch. 30/04/2043 | \$ 20 050 | \$ 18 481 | 0,69 | 6,375 % éch. 18/01/2027 | \$ 3 500 | \$ 3 105 | 0,11 | 7,500 % éch. 09/06/2028 | \$ 4 400 | \$ 4 604 | 0,17 | | | |
| 6,550 % éch. 03/04/2034 | 1 200 | 1 246 | 0,05 | 7,125 % éch. 20/01/2050 | 13 600 | 9 684 | 0,36 | Banque de développement hongroise | | | | | | |
| 7,158 % éch. 12/03/2045 | 2 400 | 2 554 | 0,09 | 7,625 % éch. 21/09/2034 | 1 100 | 819 | 0,03 | 6,500 % éch. 29/06/2028 | 10 700 | 11 034 | 0,41 | | | |
| 7,300 % éch. 13/11/2054 | 4 200 | 4 567 | 0,17 | 7,625 % éch. 01/02/2041 | 250 | 189 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement hongrois | | | | | | |
| Total Costa Rica | | 26 848 | 1,00 | 7,650 % éch. 15/06/2035 | 1 000 | 784 | 0,03 | 1,625 % éch. 28/04/2032 | € 1 200 | 1 082 | 0,04 | | | |
| CHYPRE | | | | GABON | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| Atrium Finance PLC | | | | Obligation internationale du gouvernement gabonais | | | | Magyar Export-Import Bank | | | | | | |
| 2,625 % éch. 05/09/2027 | € 8 000 | 6 897 | 0,26 | 6,625 % éch. 06/02/2031 | 600 | 502 | 0,02 | 6,000 % éch. 05/06/2035 | € 10 700 | 11 034 | 0,41 | | | |
| RÉPUBLIQUE DOMINICAINE | | | | GÉORGIE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| Billets de la Banque centrale de République dominicaine | | | | Georgian Railway JSC | | | | Indian Railway Finance Corp. Ltd. | | | | | | |
| 12,000 % éch. 03/10/2025 | DOP 36 900 | 648 | 0,02 | 4,000 % éch. 17/06/2028 | 10 700 | 9 876 | 0,37 | 3,570 % éch. 21/01/2032 | 16 100 | 14 470 | 0,54 | | | |
| 13,000 % éch. 05/12/2025 | 647 400 | 11 693 | 0,44 | GHANA | | | | 3,835 % éch. 13/12/2027 | 3 500 | 3 351 | 0,13 | | | |
| 13,000 % éch. 30/01/2026 | 273 800 | 4 958 | 0,18 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | JSW Hydro Energy Ltd. | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | | | | Obligation internationale du gouvernement du Ghana | | | | 4,125 % éch. 18/05/2031 | 3 824 | 3 336 | 0,12 | | | |
| 4,500 % éch. 30/01/2030 | \$ 3 000 | 2 771 | 0,10 | 0,000 % éch. 07/04/2025 ^ | 1 400 | 539 | 0,02 | ReNew Power Pvt Ltd. | | | | | | |
| 4,875 % éch. 23/09/2032 | 7 800 | 7 121 | 0,27 | 6,375 % éch. 11/02/2027 ^ | 8 200 | 3 682 | 0,14 | 5,875 % éch. 05/03/2027 | 1 202 | 1 150 | 0,04 | | | |
| 5,300 % éch. 21/01/2041 | 8 800 | 7 634 | 0,28 | 7,625 % éch. 16/05/2029 ^ | 3 300 | 1 447 | 0,05 | ReNew Wind Energy AP2 | | | | | | |
| 5,500 % éch. 27/01/2025 | 2 500 | 2 491 | 0,09 | 7,750 % éch. 07/04/2029 ^ | 2 700 | 1 187 | 0,04 | 4,500 % éch. 14/07/2028 | 10 000 | 8 896 | 0,33 | | | |
| 5,500 % éch. 22/02/2029 | 8 800 | 8 624 | 0,32 | 7,875 % éch. 11/02/2035 ^ | 5 700 | 2 510 | 0,09 | Wipro IT Services LLC | | | | | | |
| 5,875 % éch. 30/01/2060 | 31 800 | 27 587 | 1,03 | 8,125 % éch. 26/03/2032 ^ | 11 300 | 4 998 | 0,19 | 1,500 % éch. 23/06/2026 | 4 800 | 4 400 | 0,16 | | | |
| 5,950 % éch. 25/01/2027 | 8 400 | 8 449 | 0,31 | 8,625 % éch. 07/04/2034 ^ | 7 900 | 3 470 | 0,13 | Total Inde | | 38 634 | 1,43 | | | |
| 6,000 % éch. 19/07/2028 | 1 520 | 1 526 | 0,06 | 8,627 % éch. 16/06/2049 ^ | 1 600 | 689 | 0,03 | INDONÉSIE | | | | | | |
| 6,000 % éch. 22/02/2033 | 1 700 | 1 681 | 0,06 | 8,750 % éch. 11/03/2061 ^ | 29 450 | 12 789 | 0,47 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| 6,400 % éch. 05/06/2049 | 2 500 | 2 362 | 0,09 | 8,875 % éch. 07/05/2042 ^ | 1 100 | 475 | 0,02 | Bank Mandiri Persero Tbk PT | | | | | | |
| 6,500 % éch. 15/02/2048 | 200 | 192 | 0,01 | 8,950 % éch. 26/03/2051 ^ | 6 700 | 2 911 | 0,11 | 2,000 % éch. 19/04/2026 | 6 700 | 6 220 | 0,23 | | | |
| 6,850 % éch. 27/01/2045 | 2 800 | 2 800 | 0,10 | Total Ghana | | 34 697 | 1,29 | Pelabuhan Indonesia Persero PT | | | | | | |
| 6,875 % éch. 29/01/2026 | 4 200 | 4 286 | 0,16 | GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | 4,250 % éch. 05/05/2025 | 6 500 | 6 381 | 0,23 | | | |
| 8,625 % éch. 20/04/2027 | 6 500 | 6 819 | 0,25 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,375 % éch. 05/05/2045 | 3 000 | 2 920 | 0,11 | | | |
| 9,750 % éch. 05/06/2026 | DOP 129 900 | 2 240 | 0,08 | Globalworth Real Estate Investments Ltd. | | | | (g) | | | | | | |
| 11,250 % éch. 15/09/2035 | 374 000 | 6 969 | 0,26 | 2,950 % éch. 29/07/2026 | € 3 500 | 3 191 | 0,12 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia | | | | | | |
| 13,625 % éch. 03/02/2033 | 330 100 | 6 936 | 0,26 | HONG KONG | | | | 4,700 % éch. 06/06/2032 | 24 800 | 25 065 | 0,93 | | | |
| 13,625 % éch. 10/02/2034 | 113 700 | 2 369 | 0,09 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | 40 586 | 1,50 | | | |
| Total République dominicaine | | 120 156 | 4,46 | AIA Group Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement indonésien | | | | | | |
| ÉQUATEUR | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| Ecuador Social Bond SARL | | | | Airport Authority Hong Kong | | | | 1,300 % éch. 23/03/2034 | | | | € 13 100 | 11 390 | 0,42 |
| 0,000 % éch. 30/01/2035 | \$ 8 667 | 6 587 | 0,24 | 2,100 % éch. 08/03/2026 | 1 200 | 1 121 | 0,04 | 4,750 % éch. 18/07/2047 | \$ 4 400 | 4 367 | 0,16 | | | |
| (a) | | | | (d) | | | | (g) | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement d'Équateur | | | | Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong | | | | 5,125 % éch. 15/01/2045 | | | | 1 200 | 1 241 | 0,05 |
| 0,000 % éch. 31/07/2030 | | | | 2,375 % éch. 02/02/2051 | 1 200 | 816 | 0,03 | 5,125 % éch. 15/01/2045 | (g) | | | | | |
| (a) | 10 286 | 2 968 | 0,11 | 3,750 % éch. 07/06/2032 | € 5 500 | 6 358 | 0,23 | (g) | 1 264 | 1 308 | 0,05 | | | |
| 2,500 % éch. 31/07/2040 | 5 157 | 1 650 | 0,06 | 5,250 % éch. 11/01/2053 | \$ 3 500 | 3 951 | 0,15 | 5,250 % éch. 08/01/2047 | 200 | 209 | 0,01 | | | |
| 3,500 % éch. 31/07/2035 | 67 953 | 24 429 | 0,91 | Total Hong Kong | | | | 5,650 % éch. 11/01/2053 | 700 | 772 | 0,03 | | | |
| 6,000 % éch. 31/07/2030 | 31 524 | 14 753 | 0,55 | | | 45 926 | 1,70 | 7,750 % éch. 17/01/2038 | 3 280 | 4 216 | 0,16 | | | |
| | | 43 800 | 1,63 | | | | | 8,500 % éch. 12/10/2035 | 1 055 | 1 406 | 0,05 | | | |
| Total Équateur | | 50 387 | 1,87 | | | | | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia | | | | | | |
| ÉGYPTE | | | | INTERNATIONALES | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien | | | | Project Mercury | | | | 8,127 % éch. 11/08/2030 | | | | € 4 800 | 5 319 | 0,20 |
| 4,750 % éch. 11/04/2025 | € 7 500 | 7 565 | 0,28 | 8,127 % éch. 11/08/2030 | | | | 8,127 % éch. 11/08/2030 | | | | € 4 800 | 5 319 | 0,20 |
| 5,250 % éch. 06/10/2025 | \$ 14 400 | 13 132 | 0,49 | | | | | | | | | | | |
| (g) | | | | | | | | | | | | | | |
| 5,750 % éch. 29/05/2024 | (g) | 700 | 686 | | | | | | | | | | | |
| (g) | | | | | | | | | | | | | | |
| 5,875 % éch. 16/02/2031 | € 1 500 | 987 | 0,04 | | | | | | | | | | | |
| 6,375 % éch. 11/04/2031 | € 19 500 | 13 906 | 0,52 | | | | | | | | | | | |
| 7,053 % éch. 15/01/2032 | \$ 5 400 | 3 715 | 0,14 | | | | | | | | | | | |
| 7,300 % éch. 30/09/2033 | 6 900 | 4 575 | 0,17 | | | | | | | | | | | |
| 7,500 % éch. 16/02/2061 | 10 800 | 6 342 | 0,23 | | | | | | | | | | | |
| 7,625 % éch. 29/05/2032 | 9 300 | 6 487 | 0,24 | | | | | | | | | | | |
| 7,903 % éch. 21/02/2048 | 5 700 | 3 453 | 0,13 | | | | | | | | | | | |
| 8,150 % éch. 20/11/2059 | 3 500 | 2 160 | 0,08 | | | | | | | | | | | |
| 8,500 % éch. 31/01/2047 | 4 000 | 2 500 | 0,09 | | | | | | | | | | | |
| 8,750 % éch. 30/09/2051 | 8 500 | 5 397 | 0,20 | | | | | | | | | | | |
| Total Égypte | | 70 905 | 2,63 | | | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| IRLANDE | | | | MALAISIE | | | | NAMIBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC | | | | 6,960 % éch. 13/03/2027 | € 6 500 | \$ 7 519 | 0,28 | Obligation internationale du gouvernement namibien | | | |
| 5,950 % éch. 15/04/2030 ^(e) | \$ 3 900 | \$ 234 | 0,01 | Total Macédoine du Nord | | 11 415 | 0,42 | 5,250 % éch. 29/10/2025 | \$ 2 300 | \$ 2 278 | 0,08 |
| Sovcombank Via SovCom Capital DAC | | | | ÎLE MAURICE | | | | PAYS-BAS | | | |
| 3,400 % éch. 26/01/2025 [^] | 5 400 | 146 | 0,01 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Total Irlande | | 380 | 0,02 | Axiata SPV5 Labuan Ltd. | \$ 4 600 | 3 182 | 0,12 | IHS Netherlands Holdco BV | | | |
| CÔTE D'IVOIRE | | | | Khazanah Capital Ltd. | | | | 8,000 % éch. 18/09/2027 | 10 500 | 9 387 | 0,35 |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | 4,876 % éch. 01/06/2033 | 4 300 | 4 324 | 0,16 | ING Groep NV | | | |
| République de Côte d'Ivoire | | | | Khazanah Global Sukuk Bhd. | | | | 1,125 % éch. 07/12/2028 (g) | £ 4 000 | 4 482 | 0,17 |
| 9,055 % éch. 19/03/2027 | € 1 050 | 1 119 | 0,04 | 4,687 % éch. 01/06/2028 | 5 600 | 5 620 | 0,21 | 1,400 % éch. 01/07/2026 (g) | \$ 7 900 | 7 439 | 0,28 |
| Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | | | | Total Malaisie | | 13 126 | 0,49 | InterCement Financial Operations BV | | | |
| 5,250 % éch. 22/03/2030 | 17 900 | 17 819 | 0,66 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,750 % éch. 17/07/2024 | 200 | 142 | 0,01 |
| 5,875 % éch. 17/10/2031 (g) | 4 200 | 4 171 | 0,15 | India Green Energy Holdings | 9 400 | 9 307 | 0,35 | Metinvest BV | | | |
| 6,625 % éch. 22/03/2048 | 2 900 | 2 563 | 0,10 | 5,375 % éch. 29/04/2024 | | | | 8,500 % éch. 23/04/2026 | 1 100 | 775 | 0,03 |
| | | 24 553 | 0,91 | MEXIQUE | | | | NE Property BV | | | |
| Total Côte d'Ivoire | | 25 672 | 0,95 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,000 % éch. 20/01/2030 (g) | € 5 600 | 4 979 | 0,18 |
| JAMAÏQUE | | | | Banco Mercantil del Norte S.A. | | | | 3,375 % éch. 14/07/2027 (g) | 2 300 | 2 405 | 0,09 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 6,625 % éch. 24/01/2032 (d)(e) | 2 000 | 1 704 | 0,06 | Prosus NV | | | |
| Obligation internationale du gouvernement jamaïcain | | | | 7,500 % éch. 27/06/2029 (d)(e) | 3 400 | 3 212 | 0,12 | 1,539 % éch. 03/08/2028 | 800 | 765 | 0,03 |
| 7,875 % éch. 28/07/2045 | \$ 3 300 | 4 026 | 0,15 | 7,625 % éch. 10/01/2028 (d)(e) | 300 | 289 | 0,01 | 2,031 % éch. 03/08/2032 | 400 | 339 | 0,01 |
| JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | 8,375 % éch. 14/10/2030 (d)(e) | 400 | 395 | 0,02 | 3,257 % éch. 19/01/2027 | \$ 2 200 | 2 034 | 0,07 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Corp. GEO S.A.B. de C.V. | | | | 4,027 % éch. 03/08/2050 | 800 | 525 | 0,02 |
| Corsair International Ltd. | | | | 8,875 % éch. 25/09/2014 [^] | 500 | 0 | 0,00 | Total Pays-Bas | | 33 272 | 1,24 |
| 8,802 % éch. 28/01/2027 | € 7 900 | 8 727 | 0,32 | Metalsa S.A. de C.V. | | | | OMAN | | | |
| 9,152 % éch. 28/01/2029 | 3 400 | 3 756 | 0,14 | 3,750 % éch. 04/05/2031 | 10 600 | 8 733 | 0,32 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Total Jersey, Îles Anglo-normandes | | 12 483 | 0,46 | Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V. | 6 300 | 5 862 | 0,22 | Obligation internationale du gouvernement omanais | | | |
| JORDANIE | | | | Trust Fibra Uno | | | | 4,750 % éch. 15/06/2026 | 4 600 | 4 553 | 0,17 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 6,390 % éch. 15/01/2050 | 1 000 | 811 | 0,03 | 4,875 % éch. 01/02/2025 | 3 000 | 2 981 | 0,11 |
| Obligation internationale du gouvernement jordanien | | | | | | 21 006 | 0,78 | 5,375 % éch. 08/03/2027 | 5 600 | 5 650 | 0,21 |
| 5,750 % éch. 31/01/2027 | \$ 300 | 295 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | | 5,625 % éch. 17/01/2028 | 8 200 | 8 371 | 0,31 |
| 6,125 % éch. 29/01/2026 | 3 000 | 2 998 | 0,11 | 1,350 % éch. 18/09/2027 | € 600 | 620 | 0,02 | 6,000 % éch. 01/08/2029 | 18 200 | 18 895 | 0,70 |
| 7,375 % éch. 10/10/2047 | 7 100 | 6 330 | 0,24 | 2,250 % éch. 12/08/2036 | 9 700 | 8 456 | 0,31 | 6,250 % éch. 25/01/2031 | 4 900 | 5 164 | 0,19 |
| 7,500 % éch. 13/01/2029 | 8 500 | 8 630 | 0,32 | 2,750 % éch. 27/11/2031 (c) | 197 146 | 10 280 | 0,38 | 6,500 % éch. 08/03/2047 | 2 650 | 2 710 | 0,10 |
| Total Jordanie | | 18 253 | 0,68 | 3,000 % éch. 03/12/2026 (c) | 612 987 | 33 626 | 1,25 | 6,750 % éch. 28/10/2027 | 14 400 | 15 230 | 0,57 |
| KAZAKHSTAN | | | | 3,750 % éch. 19/04/2071 | \$ 1 100 | 737 | 0,03 | 6,750 % éch. 17/01/2048 | 6 700 | 7 027 | 0,26 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 4,000 % éch. 30/11/2028 (c) | 89 218 | 5 152 | 0,19 | 7,000 % éch. 25/01/2051 | 4 400 | 4 761 | 0,18 |
| Obligation internationale du gouvernement kazakh | | | | 4,875 % éch. 19/05/2033 | \$ 25 700 | 24 818 | 0,92 | Total Oman | | 75 342 | 2,80 |
| 4,875 % éch. 14/10/2044 | 8 700 | 8 442 | 0,31 | 5,750 % éch. 12/10/2110 | 23 940 | 21 515 | 0,80 | PAKISTAN | | | |
| 6,500 % éch. 21/07/2045 | 14 600 | 16 738 | 0,62 | 6,338 % éch. 04/05/2053 | 3 900 | 3 980 | 0,15 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Total Kazakhstan | | 25 180 | 0,93 | | | 109 184 | 4,05 | Obligation internationale du gouvernement pakistanais | | | |
| KENYA | | | | Total Mexique | | 130 190 | 4,83 | 6,875 % éch. 05/12/2027 | 5 515 | 3 786 | 0,14 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | MONGOLIE | | | | 7,375 % éch. 08/04/2031 | 5 418 | 3 321 | 0,12 |
| Obligation internationale du gouvernement kenyan | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 8,250 % éch. 15/04/2024 | 3 090 | 2 938 | 0,11 |
| 6,300 % éch. 23/01/2034 | 5 700 | 4 588 | 0,17 | Obligation internationale du gouvernement mongol | | | | 8,875 % éch. 08/04/2051 | 3 000 | 1 823 | 0,07 |
| 6,875 % éch. 24/06/2024 | 6 100 | 5 941 | 0,22 | 3,500 % éch. 07/07/2027 | 7 000 | 6 264 | 0,23 | Total Pakistan | | 11 868 | 0,44 |
| Total Kenya | | 10 529 | 0,39 | 5,125 % éch. 07/04/2026 | 1 100 | 1 070 | 0,04 | PANAMA | | | |
| LUXEMBOURG | | | | 7,875 % éch. 05/06/2029 | 800 | 819 | 0,03 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 8,650 % éch. 19/01/2028 | 268 | 281 | 0,01 | Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A. | | | |
| Amaggi Luxembourg International SARL | | | | Total Mongolie | | 8 434 | 0,31 | 5,125 % éch. 11/08/2061 | 2 900 | 2 212 | 0,08 |
| 5,250 % éch. 28/01/2028 | 6 000 | 5 765 | 0,21 | MAROC | | | | Banco General S.A. | | | |
| MACÉDOINE DU NORD | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,250 % éch. 07/05/2031 (d) | 6 500 | 5 589 | 0,21 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Obligation internationale du gouvernement marocain | | | | Banco Nacional de Panama | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du nord | | | | 4,000 % éch. 15/12/2050 | 19 500 | 14 113 | 0,52 | 2,500 % éch. 11/08/2030 | 600 | 446 | 0,01 |
| 2,750 % éch. 18/01/2025 | € 3 600 | 3 896 | 0,14 | 5,500 % éch. 11/12/2042 | 4 100 | 3 741 | 0,14 | Empresa de Transmision Electrica S.A. | | | |
| | | | | Total Maroc | | 17 854 | 0,66 | 5,125 % éch. 02/05/2049 | 1 000 | 727 | 0,03 |
| | | | | MULTINATIONALES | | | | | | 8 974 | 0,33 |
| | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| | | | | NXP BV | | | | Obligation internationale du gouvernement panaméen | | | |
| | | | | 3,400 % éch. 01/05/2030 | 500 | 460 | 0,02 | 2,252 % éch. 29/09/2032 | 2 600 | 1 902 | 0,07 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | | | | | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|--|--|--------|------|------|-------|-------|------|
| 6,875 % éch. 31/01/2036 | \$ 2 600 | \$ 2 601 | 0,10 | 2,875 % éch. 13/04/2042 (g) | € 8 100 | \$ 6 077 | 0,23 | Hyundai Capital Services, Inc. | | | | | | | | | | |
| 8,125 % éch. 28/04/2034 | 1 000 | 1 062 | 0,04 | 3,375 % éch. 28/01/2050 (g) | 6 200 | 4 684 | 0,17 | 1,250 % éch. 08/02/2026 | \$ 8 200 | \$ 7 538 | 0,28 | | | | | | | |
| | | 74 049 | 2,75 | 3,500 % éch. 03/04/2034 (g) | 10 300 | 9 695 | 0,36 | KB Kookmin Card Co. Ltd. | | | | | | | | | | |
| Total Panama | | 83 023 | 3,08 | 3,750 % éch. 07/02/2034 | 950 | 905 | 0,03 | 1,500 % éch. 13/05/2026 | 10 000 | 9 156 | 0,34 | | | | | | | |
| PARAGUAY | | | | 4,125 % éch. 11/03/2039 | 1 000 | 921 | 0,03 | 4,000 % éch. 09/06/2025 | 7 900 | 7 746 | 0,29 | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 4,625 % éch. 03/04/2049 (g) | 2 200 | 2 047 | 0,08 | Kodit Global Co. Ltd. | | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen | | | | 5,000 % éch. 27/09/2026 | 1 450 | 1 647 | 0,06 | 4,954 % éch. 25/05/2026 | 1 200 | 1 198 | 0,04 | | | | | | | |
| 2,739 % éch. 29/01/2033 | 1 900 | 1 568 | 0,06 | 6,125 % éch. 22/01/2044 | \$ 1 200 | 1 187 | 0,04 | Kookmin Bank | | | | | | | | | | |
| 3,849 % éch. 28/06/2033 | 1 900 | 1 690 | 0,06 | 6,375 % éch. 18/09/2033 | € 2 200 | 2 574 | 0,10 | 2,500 % éch. 04/11/2030 (e) | 2 500 | 2 084 | 0,08 | | | | | | | |
| 4,700 % éch. 27/03/2027 | 2 300 | 2 272 | 0,09 | 6,625 % éch. 27/09/2029 | 1 900 | 2 248 | 0,08 | Mirae Asset Securities Co. Ltd. | | | | | | | | | | |
| 5,400 % éch. 30/03/2050 | 14 900 | 13 287 | 0,49 | 7,625 % éch. 17/01/2053 | \$ 8 300 | 9 326 | 0,35 | 1,375 % éch. 07/07/2024 | 17 600 | 17 205 | 0,63 | | | | | | | |
| 5,600 % éch. 13/03/2048 | 1 800 | 1 646 | 0,06 | Total Roumanie | | 93 774 | 3,48 | NongHyup Bank | | | | | | | | | | |
| 5,850 % éch. 21/08/2033 | 2 700 | 2 749 | 0,10 | RUSSIE | | | | 1,250 % éch. 28/07/2026 | 13 000 | 11 833 | 0,44 | | | | | | | |
| 6,100 % éch. 11/08/2044 | 1 800 | 1 774 | 0,07 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Shinhan Bank Co. Ltd. | | | | | | | | | | |
| Total Paraguay | | 24 986 | 0,93 | MMK International Capital DAC | | | | 4,375 % éch. 13/04/2032 (e) | 9 000 | 8 344 | 0,31 | | | | | | | |
| PÉROU | | | | 4,375 % éch. 13/06/2024 ^ | | | | 2 800 | 168 | 0,01 | Shinhan Card Co. Ltd. | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | SÉNÉGAL | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | |
| InRetail Consumer | | | | Obligation internationale du gouvernement sénégalais | | | | Obligation internationale du gouvernement sénégalais | | | | | | | | | | |
| 3,250 % éch. 22/03/2028 | 3 700 | 3 324 | 0,12 | 4,750 % éch. 13/03/2028 | € 1 200 | 1 228 | 0,04 | 4,750 % éch. 12/04/2027 | 12 072 | 11 806 | 0,44 | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,375 % éch. 08/06/2037 | | | | 11 800 | 9 672 | 0,36 | Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | | | | | |
| Fondo MIVIVIENDA S.A. | | | | 6,250 % éch. 23/05/2033 | | | | \$ 5 600 | 5 019 | 0,19 | 1,950 % éch. 17/11/2036 | € 8 300 | 6 942 | 0,26 | | | | |
| 4,625 % éch. 12/04/2027 | 12 072 | 11 806 | 0,44 | Total Sénégal | | | | 15 919 | 0,59 | 3,000 % éch. 15/01/2034 | \$ 8 700 | 7 370 | 0,27 | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | | SERBIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | |
| 1,950 % éch. 17/11/2036 | € 8 300 | 6 942 | 0,26 | Obligation internationale du gouvernement serbe | | | | Obligation internationale du gouvernement serbe | | | | | | | | | | |
| 3,000 % éch. 15/01/2034 | \$ 8 700 | 7 370 | 0,27 | 1,000 % éch. 23/09/2028 | € 23 100 | 21 597 | 0,80 | 1,500 % éch. 26/06/2029 | 3 000 | 2 804 | 0,11 | | | | | | | |
| 3,600 % éch. 15/01/2072 | 8 200 | 5 804 | 0,22 | 1,650 % éch. 03/03/2033 | 11 900 | 9 757 | 0,36 | 1,650 % éch. 03/03/2033 | 11 900 | 9 757 | 0,36 | | | | | | | |
| | | 31 922 | 1,19 | 6,500 % éch. 26/09/2033 | \$ 9 500 | 9 773 | 0,36 | 6,500 % éch. 26/09/2033 | \$ 9 500 | 9 773 | 0,36 | | | | | | | |
| Total Pérou | | 35 246 | 1,31 | Total Serbie | | | | 43 931 | 1,63 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | |
| PHILIPPINES | | | | SINGAPOUR | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | Export-Import Bank of Korea | | | | | | | | | | |
| Globe Telecom, Inc. | | | | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. | | | | 2,125 % éch. 18/01/2032 | | | | 16 500 | 13 859 | 0,52 | | | | |
| 4,200 % éch. 02/08/2026 (d) | 6 500 | 6 154 | 0,23 | 4,250 % éch. 25/03/2027 | 5 040 | 4 610 | 0,17 | 4,875 % éch. 11/01/2026 | 200 | 201 | 0,01 | | | | | | | |
| PLDT, Inc. | | | | Flex Ltd. | | | | 5,125 % éch. 11/01/2033 | 8 400 | 8 737 | 0,32 | | | | | | | |
| 3,450 % éch. 23/06/2050 | 3 900 | 2 698 | 0,10 | 4,875 % éch. 15/06/2029 | 200 | 197 | 0,01 | Korea Expressway Corp. | | | | | | | | | | |
| | | 8 852 | 0,33 | United Overseas Bank Ltd. | | | | 1,125 % éch. 17/05/2026 | 4 800 | 4 402 | 0,16 | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 1,250 % éch. 14/04/2026 | | | | 6 500 | 6 011 | 0,22 | Korea Water Resources Corp. | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement philippin | | | | Total Singapour | | | | 10 818 | 0,40 | 3,500 % éch. 27/04/2025 | 6 500 | 6 373 | 0,24 | | | | | |
| 4,200 % éch. 29/03/2047 | 9 000 | 8 068 | 0,30 | SLOVÉNIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 17/01/2048 | 18 200 | 19 240 | 0,71 | Obligation internationale du gouvernement slovène | | | | Español-Import Bank of Korea | | | | | | | | | | |
| 9,500 % éch. 02/02/2030 | 1 100 | 1 387 | 0,05 | 5,000 % éch. 19/09/2033 | 9 100 | 9 278 | 0,34 | 2,125 % éch. 18/01/2032 | 16 500 | 13 859 | 0,52 | | | | | | | |
| | | 28 695 | 1,06 | AFRIQUE DU SUD | | | | 4,875 % éch. 11/01/2026 | | | | 200 | 201 | 0,01 | | | | |
| Total Philippines | | 37 547 | 1,39 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,125 % éch. 11/01/2033 | | | | 8 400 | 8 737 | 0,32 | | | | |
| POLOGNE | | | | Banque de développement d'Afrique du Sud | | | | Korea Expressway Corp. | | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 8,600 % éch. 21/10/2024 (f) ZAR | | | | 1,125 % éch. 17/05/2026 | | | | 4 800 | 4 402 | 0,16 | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement polonais | | | | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | | Korea Water Resources Corp. | | | | | | | | | | |
| 4,875 % éch. 04/10/2033 (g) | 22 000 | 22 358 | 0,83 | 4,850 % éch. 30/09/2029 | \$ 7 000 | 6 582 | 0,25 | 3,500 % éch. 27/04/2025 | 6 500 | 6 373 | 0,24 | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 04/04/2053 | 11 200 | 11 707 | 0,43 | 4,875 % éch. 14/04/2026 | 4 200 | 4 152 | 0,15 | | | | | | | | | | | |
| Total Pologne | | 34 065 | 1,26 | 5,375 % éch. 24/07/2044 | 4 300 | 3 442 | 0,13 | | | | | | | | | | | |
| QATAR | | | | 5,750 % éch. 30/09/2049 | | | | 19 200 | 15 391 | 0,57 | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 10,500 % éch. 21/12/2026 (g) | | | | ZAR 565 700 | 32 384 | 1,20 | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement qatari | | | | Total Afrique du Sud | | | | 75 759 | 2,81 | | | | | | | | | |
| 4,400 % éch. 16/04/2050 | 20 100 | 18 567 | 0,69 | CORÉE DU SUD | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | |
| 4,817 % éch. 14/03/2049 | 12 465 | 12 162 | 0,45 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Banco Santander S.A. | | | | | | | | | | |
| 5,103 % éch. 23/04/2048 | 6 000 | 6 088 | 0,23 | Doosan Enerbility Co. Ltd. | | | | 5,147 % éch. 18/08/2025 (g) | | | | 9 600 | 9 548 | 0,35 | | | | |
| Total Qatar | | 36 817 | 1,37 | 5,500 % éch. 17/07/2026 | \$ 13 000 | 13 160 | 0,49 | SRI LANKA | | | | | | | | | | |
| ROUMANIE | | | | Hana Bank | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 3,500 % éch. 19/10/2026 (d)(e) | | | | 6 500 | 5 906 | 0,22 | Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement roumain | | | | Hanwha Life Insurance Co. Ltd. | | | | 5,750 % éch. 18/04/2023 ^ | | | | 5 600 | 2 881 | 0,11 | | | | |
| 1,750 % éch. 13/07/2030 (g) | € 4 200 | 3 763 | 0,14 | 3,379 % éch. 04/02/2032 | 6 700 | 6 181 | 0,23 | 5,875 % éch. 25/07/2022 ^ | 1 236 | 654 | 0,02 | | | | | | | |
| 2,000 % éch. 08/12/2026 (g) | 500 | 520 | 0,02 | AFRIQUE DU SUD | | | | 6,125 % éch. 03/06/2025 ^ | | | | 3 700 | 1 910 | 0,07 | | | | |
| 2,000 % éch. 14/04/2033 (g) | 11 300 | 9 371 | 0,35 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,200 % éch. 11/05/2027 ^ | | | | 4 100 | 2 082 | 0,08 | | | | |
| 2,124 % éch. 16/07/2031 (g) | 28 810 | 25 436 | 0,94 | African Export-Import Bank | | | | 6,750 % éch. 18/04/2028 ^ | | | | 5 800 | 2 932 | 0,11 | | | | |
| 2,125 % éch. 07/03/2028 (g) | 1 600 | 1 608 | 0,06 | 2,634 % éch. 17/05/2026 | 5 300 | 4 901 | 0,18 | 6,825 % éch. 18/07/2026 ^ | 3 800 | 1 955 | 0,07 | | | | | | | |
| 2,125 % éch. 07/03/2028 | 3 000 | 3 014 | 0,11 | Banque de développement asiatique | | | | 6,850 % éch. 14/03/2024 ^ | | | | 6 100 | 3 106 | 0,12 | | | | |
| 2,625 % éch. 02/12/2040 | 3 950 | 2 946 | 0,11 | 4,700 % éch. 12/03/2024 MXN | | | | 89 800 | 5 229 | 0,20 | 6,850 % éch. 03/11/2025 ^ | 3 000 | 1 553 | 0,06 | | | | |
| 2,750 % éch. 14/04/2041 | 7 800 | 5 805 | 0,22 | 6,550 % éch. 26/01/2025 ZAR | | | | 118 000 | 6 300 | 0,23 | 7,550 % éch. 28/03/2030 ^ | 16 800 | 8 482 | 0,31 | | | | |
| | | | | | | | | | | | | 7,850 % éch. 14/03/2029 ^ | 1 600 | 808 | 0,03 | | | |
| | | | | | | | | | | | | Total Sri Lanka | 26 363 | 0,98 | | | | |
| | | | | | | | | | | | | SUPRANATIONALES | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | Banque de développement et de commerce d'Afrique orientale et australe | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | 4,125 % éch. 30/06/2028 | | | | 5 900 | 5 112 | 0,19 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 % | 20/10/2033 | £ 900 | \$ 100 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 21/09/2024 | \$ 63 400 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2024 | 68 300 | (348) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/12/2031 | 1 800 | (279) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 70 600 | (2 045) | (0,07) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 9 250 | 529 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730 | 03/08/2033 | 2 300 | 41 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735 | 07/08/2033 | 2 700 | 51 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 1 700 | 167 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870 | 17/10/2053 | 1 400 | 148 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880 | 16/10/2053 | 1 700 | 183 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 1 300 | 60 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 3 400 | 195 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155 | 02/10/2033 | 4 500 | 258 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165 | 27/09/2033 | 5 500 | 320 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 5 900 | 346 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 4 000 | 236 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 3 100 | 196 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 | 23/10/2033 | 2 800 | 180 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2034 | 9 100 | (90) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255 | 23/10/2033 | 2 200 | 146 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393 | 25/10/2033 | 200 | 16 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 2 500 | 209 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,850 | 02/01/2025 | BRL 68 400 | 19 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,240 | 02/01/2025 | 160 300 | 60 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,055 | 04/01/2027 | 81 200 | (1 108) | (0,04) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,216 | 02/01/2025 | 28 100 | (146) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,241 | 02/01/2025 | 28 200 | (149) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,427 | 02/01/2025 | 66 100 | (392) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,428 | 02/01/2025 | 93 200 | 556 | 0,02 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,950 | 30/11/2024 | ZAR 346 600 | 406 | 0,01 |
| À payer ⁽³⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | AUD 101 000 | 1 871 | 0,07 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2028 | 43 400 | 1 119 | 0,04 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,855 | 18/12/2033 | CLP 8 000 000 | (53) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,511 | 13/11/2033 | 8 456 600 | (411) | (0,02) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,175 | 07/11/2028 | CZK 1 243 200 | 1 389 | 0,05 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,611 | 06/06/2028 | 139 300 | 264 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 12 000 | (540) | (0,02) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 15 500 | 337 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 3 700 | 289 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 1 000 | 46 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,450 | 20/10/2028 | 4 300 | 214 | 0,01 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,455 | 10/01/2028 | PLN 18 000 | (255) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,490 | 10/01/2028 | 17 100 | (249) | (0,01) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,769 | 27/09/2028 | MXN 79 850 | (214) | (0,01) |
| | | | | | \$ 3 668 | 0,14 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 3 669 | 0,14 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| MYI | Option de vente - GBP contre USD hors cote | \$ 1,160 | 12/06/2024 | 52 520 | \$ 209 | \$ 112 | 0,00 |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 2 800 | \$ (57) | \$ (8) | \$ (65) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000) | 20/12/2028 | 9 900 | 4 | (59) | (55) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement omanais | (1,000) | 20/12/2027 | 2 200 | 72 | (76) | (4) | 0,00 |
| BPS | Obligation internationale du gouvernement turc | (1,000) | 20/12/2026 | 4 300 | 715 | (598) | 117 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) | 20/12/2028 | 1 740 | (35) | (5) | (40) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | (1,000) | 20/12/2028 | 2 800 | 1 | (17) | (16) | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement omanais | (1,000) | 20/12/2027 | 700 | 23 | (24) | (1) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement omanais | (1,000) | 20/12/2027 | 3 400 | 91 | (97) | (6) | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement chinois | (1,000) | 20/06/2024 | 15 000 | (167) | 106 | (61) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | (1,000) | 20/12/2026 | 2 800 | 467 | (391) | 76 | 0,00 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) | 20/12/2028 | 60 | (1) | (1) | (2) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement chinois | (1,000) | 20/06/2024 | 15 000 | (167) | 106 | (61) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) | 20/12/2028 | 62 500 | (1 841) | (257) | (2 098) | (0,08) |
| JPM | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) | 20/12/2028 | 3 600 | (73) | (10) | (83) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) | 20/12/2028 | 1 700 | (51) | (6) | (57) | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement chilien | (1,000) | 20/12/2028 | 4 800 | (97) | (14) | (111) | (0,01) |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | (1,000) | 20/12/2026 | 2 500 | 423 | (355) | 68 | 0,00 |
| | | | | | \$ (693) | \$ (1 706) | \$ (2 399) | (0,09) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--|--|---|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/06/2031 | \$ 1 200 | \$ (181) | \$ 106 | \$ (75) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2024 | 200 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement égyptien | 1,000 | 20/12/2024 | 1 000 | (120) | 52 | (68) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2028 | 11 300 | (15) | 168 | 153 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 18 100 | 13 | 140 | 153 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 6 400 | 26 | 81 | 107 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/12/2031 | 11 900 | (502) | 402 | (100) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2024 | 9 400 | (90) | 124 | 34 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2025 | 1 200 | (66) | 71 | 5 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2027 | 100 | (20) | 16 | (4) | 0,00 | |
| | BPS | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2026 | 10 400 | (639) | 739 | 100 | 0,00 |
| | | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2027 | 8 200 | (589) | 603 | 14 | 0,00 |
| | | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2024 | 3 300 | 9 | 7 | 16 | 0,00 |
| | | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2024 | 4 000 | 5 | 32 | 37 | 0,00 |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien | | 1,000 | 20/12/2024 | 200 | (24) | 10 | (14) | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain | | 1,000 | 20/12/2024 | 2 100 | (5) | 23 | 18 | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | 1,000 | 20/06/2026 | 6 100 | 54 | 48 | 102 | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement serbe | | 1,000 | 20/12/2027 | 1 600 | (142) | 103 | (39) | 0,00 | |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | 1,000 | 20/06/2028 | 32 000 | (2 762) | 1 656 | (1 106) | (0,04) | |
| Obligation internationale du gouvernement turc | | 1,000 | 20/06/2027 | 3 800 | (751) | 603 | (148) | (0,01) | |
| BRC | | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2024 | 5 800 | 18 | 10 | 28 | 0,00 |
| | | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2026 | 2 500 | 14 | 41 | 55 | 0,00 |
| | | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/12/2025 | 17 500 | 360 | (93) | 267 | 0,01 |
| CBK | | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2028 | 6 500 | 49 | 63 | 112 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2024 | 300 | (3) | 4 | 1 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2024 | 800 | 3 | 3 | 6 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement panaméen | 1,000 | 20/06/2024 | 2 300 | 4 | 4 | 8 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement panaméen | 1,000 | 20/12/2024 | 4 300 | 0 | 21 | 21 | 0,00 | |
| DUB | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 2 100 | 18 | 17 | 35 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement qatari | 1,000 | 20/12/2026 | 5 000 | 140 | (42) | 98 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement égyptien | 1,000 | 20/12/2024 | 800 | (108) | 54 | (54) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement qatari | 1,000 | 20/12/2028 | 5 300 | 80 | 50 | 130 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2024 | 13 800 | (148) | 197 | 49 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2026 | 900 | (15) | 14 | (1) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 10 400 | (638) | 572 | (66) | 0,00 | |
| GST | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2026 | 200 | (11) | 13 | 2 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2031 | 1 500 | (227) | 133 | (94) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2028 | 8 900 | 17 | 194 | 211 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2024 | 14 000 | (34) | 145 | 111 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 13 700 | 99 | 131 | 230 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2024 | 11 200 | 50 | 1 | 51 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2028 | 8 500 | 77 | 70 | 147 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement qatari | 1,000 | 20/12/2028 | 3 800 | 64 | 29 | 93 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2024 | 1 000 | (10) | 14 | 4 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2027 | 4 300 | (840) | 672 | (168) | (0,01) | |
| HUS | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 | |
| | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | 8 000 | (180) | 177 | (3) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2028 | 1 100 | (38) | 31 | (7) | 0,00 | |
| JPM | Obligation internationale du gouvernement hongrois | 1,000 | 20/06/2027 | 5 700 | (290) | 275 | (15) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2024 | 7 400 | 60 | 0 | 60 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2028 | 900 | (2) | 18 | 16 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/12/2024 | 2 400 | 6 | 16 | 22 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/06/2026 | 15 000 | 208 | 87 | 295 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement chilien | 1,000 | 20/12/2026 | 16 300 | 112 | 250 | 362 | 0,01 | |
| | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 1,000 | 20/12/2028 | 1 500 | 0 | 20 | 20 | 0,00 | |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 4 800 | 19 | 22 | 41 | 0,00 | |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 9 800 | \$ 45 | \$ 119 | \$ 164 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/12/2026 | 20 000 | 80 | 285 | 365 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement qatari | 1,000 | 20/12/2026 | 3 900 | 57 | 19 | 76 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 4 600 | (206) | 177 | (29) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2027 | 1 800 | (356) | 286 | (70) | 0,00 |
| MYI | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 1,000 | 20/06/2026 | 1 300 | 11 | 11 | 22 | 0,00 |
| | | | | | \$ (7 314) | \$ 9 095 | \$ 1 781 | 0,07 |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 1 508 | AUD 2 277 | \$ 46 | \$ 0 | \$ 46 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | CAD 1 056 | \$ 779 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | COP 170 024 801 | 42 271 | 0 | (1 565) | (1 565) | (0,06) |
| | 01/2024 | DOP 187 420 | 3 275 | 61 | 0 | 61 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 555 | 704 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 177 249 | 488 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD 6 855 | 4 177 | 0 | (164) | (164) | (0,01) |
| | 01/2024 | PLN 3 089 | 743 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 44 451 | COP 170 024 801 | 0 | (613) | (613) | (0,02) |
| | 01/2024 | 3 553 | HUF 1 313 648 | 233 | 0 | 233 | 0,01 |
| | 01/2024 | 1 801 | ¥ 265 757 | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| | 01/2024 | 503 | NOK 5 344 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 753 | PLN 11 293 | 118 | 0 | 118 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 371 | TRY 40 629 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 02/2024 | DOP 374 153 | \$ 6 486 | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 4 | CNY 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | COP 170 024 801 | \$ 43 810 | 589 | 0 | 589 | 0,02 |
| | 03/2024 | EGP 38 362 | 1 096 | 215 | 0 | 215 | 0,01 |
| | 03/2024 | \$ 3 859 | IDR 59 519 224 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 302 | INR 25 232 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 13 | PHP 703 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | 886 | EGP 35 185 | 0 | (97) | (97) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | CAD 708 | \$ 521 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 01/2024 | COP 7 391 156 | 1 883 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 13 102 | 14 274 | 4 | (206) | (202) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 2 114 | 2 682 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 3 661 387 | 10 427 | 0 | (153) | (153) | (0,01) |
| | 01/2024 | IDR 92 730 000 | 6 000 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 19 746 | 4 614 | 0 | (407) | (407) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 3 900 | AUD 5 773 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 726 | BRL 23 265 | 63 | 0 | 63 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 039 | CAD 1 409 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 934 | COP 7 391 156 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | 12 746 | € 11 673 | 152 | 0 | 152 | 0,01 |
| | 01/2024 | 1 478 | HUF 524 374 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 01/2024 | 803 | IDR 12 391 878 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 311 | ¥ 339 000 | 95 | 0 | 95 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 772 | PLN 7 729 | 193 | 0 | 193 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR 755 428 | \$ 40 749 | 0 | (504) | (504) | (0,02) |
| | 02/2024 | EGP 17 565 | 502 | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD 28 245 | 888 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 5 | CNY 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 349 | EGP 12 570 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP 1 852 598 | \$ 2 140 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 36 173 169 | 2 317 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN 4 969 | 1 338 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 55 669 | 1 583 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 1 853 | COP 7 391 156 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 459 | IDR 38 647 355 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 870 | ILS 6 768 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 048 | INR 87 644 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 849 | PEN 6 964 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 03/2024 | 535 | THB 18 483 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 06/2024 | 1 866 | KRW 2 399 991 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | | | | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|-------|---------|-------|---------|--------|--------|
| BRC | 01/2024 | € | 229 654 | \$ | 252 568 | \$ | 0 | \$ | (1 177) | \$ | (1 177) | (0,04) | |
| | 01/2024 | PLN | 12 395 | | 2 835 | | 0 | | (317) | | (317) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 799 | BRL | 3 921 | | 8 | | 0 | | 8 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 528 | HUF | 187 551 | | 12 | | 0 | | 12 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 799 | MXN | 13 634 | | 3 | | 0 | | 3 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 6 518 | TRY | 195 841 | | 51 | | (6) | | 45 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 1 535 | | 46 786 | | 0 | | (10) | | (10) | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 8 292 724 | \$ | 536 | | 0 | | (2) | | (2) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 8 188 | TRY | 256 943 | | 26 | | (36) | | (10) | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 9 557 | | 306 020 | | 0 | | (125) | | (125) | 0,00 | |
| | 06/2024 | £ | 4 144 | \$ | 5 214 | | 0 | | (72) | | (72) | 0,00 | |
| | CBK | 01/2024 | BRL | 31 125 | | 6 392 | | 0 | | (15) | | (15) | 0,00 |
| | | 01/2024 | CAD | 1 065 | | 798 | | 0 | | (10) | | (10) | 0,00 |
| | | 01/2024 | CLP | 3 235 742 | | 3 649 | | 0 | | (56) | | (56) | 0,00 |
| | | 01/2024 | COP | 7 391 156 | | 1 934 | | 26 | | 0 | | 26 | 0,00 |
| | | 01/2024 | € | 2 544 | | 2 773 | | 0 | | (38) | | (38) | 0,00 |
| 01/2024 | | £ | 160 | | 203 | | 0 | | (1) | | (1) | 0,00 | |
| 01/2024 | | HUF | 11 000 | | 32 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | |
| 01/2024 | | MXN | 484 444 | | 27 077 | | 0 | | (1 401) | | (1 401) | (0,05) | |
| 01/2024 | | PLN | 7 307 | | 1 728 | | 0 | | (130) | | (130) | (0,01) | |
| 01/2024 | | \$ | 1 072 | AUD | 1 594 | | 16 | | 0 | | 16 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 3 734 | CAD | 4 997 | | 56 | | 0 | | 56 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 1 553 | CHF | 1 353 | | 55 | | 0 | | 55 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 3 685 | CLP | 3 230 268 | | 14 | | 0 | | 14 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 1 875 | COP | 7 391 156 | | 32 | | 0 | | 32 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 1 121 | HUF | 386 724 | | 0 | | (3) | | (3) | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 13 337 | ¥ | 1 883 100 | | 29 | | 0 | | 29 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 6 761 | MXN | 117 695 | | 158 | | 0 | | 158 | 0,01 | |
| 01/2024 | | | 121 | NOK | 1 293 | | 6 | | 0 | | 6 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 4 322 | PLN | 18 093 | | 278 | | 0 | | 278 | 0,01 | |
| 01/2024 | | | 1 382 | SEK | 14 465 | | 54 | | 0 | | 54 | 0,00 | |
| 02/2024 | | | 3 382 | BRL | 17 111 | | 135 | | 0 | | 135 | 0,01 | |
| 02/2024 | | | 0 | EGP | 1 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | | ILS | 4 306 | \$ | 1 183 | | 0 | | (16) | | (16) | 0,00 | |
| 03/2024 | | PEN | 6 775 | | 1 792 | | 0 | | (34) | | (34) | 0,00 | |
| 03/2024 | | \$ | 3 649 | CLP | 3 249 062 | | 57 | | 0 | | 57 | 0,00 | |
| 03/2024 | | | 749 | IDR | 11 614 968 | | 4 | | 0 | | 4 | 0,00 | |
| 03/2024 | | | 4 545 | PEN | 16 918 | | 26 | | (13) | | 13 | 0,00 | |
| 04/2024 | | | 6 392 | BRL | 31 440 | | 27 | | 0 | | 27 | 0,00 | |
| DUB | | 01/2024 | € | 10 | \$ | 11 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| | | 01/2024 | \$ | 31 703 | ZAR | 601 809 | | 1 166 | | 0 | | 1 166 | 0,04 |
| | | 02/2024 | | 1 069 | EGP | 38 470 | | 0 | | (165) | | (165) | (0,01) |
| | | 03/2024 | | 558 | SGD | 738 | | 4 | | 0 | | 4 | 0,00 |
| | | 04/2024 | EGP | 43 739 | \$ | 1 148 | | 167 | | 0 | | 167 | 0,01 |
| | | 04/2024 | \$ | 1 151 | EGP | 45 448 | | 0 | | (132) | | (132) | (0,01) |
| GLM | 01/2024 | AUD | 1 971 | \$ | 1 322 | | 0 | | (24) | | (24) | 0,00 | |
| | 01/2024 | CAD | 13 437 | | 9 907 | | 0 | | (285) | | (285) | (0,01) | |
| | 01/2024 | CHF | 6 172 | | 7 043 | | 0 | | (294) | | (294) | (0,01) | |
| | 01/2024 | DOP | 979 288 | | 17 164 | | 376 | | 0 | | 376 | 0,01 | |
| | 01/2024 | HUF | 887 957 | | 2 432 | | 0 | | (127) | | (127) | 0,00 | |
| | 01/2024 | MXN | 554 532 | | 31 613 | | 0 | | (987) | | (987) | (0,04) | |
| | 01/2024 | NOK | 5 530 | | 534 | | 0 | | (11) | | (11) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 4 098 | HUF | 1 484 967 | | 182 | | 0 | | 182 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 1 297 | MXN | 22 662 | | 35 | | 0 | | 35 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 057 | NOK | 11 560 | | 82 | | 0 | | 82 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 6 393 | PLN | 25 322 | | 45 | | 0 | | 45 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 532 | TRY | 16 177 | | 9 | | 0 | | 9 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 310 | ZAR | 24 858 | | 47 | | 0 | | 47 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 429 | EGP | 15 479 | | 0 | | (65) | | (65) | 0,00 | |
| | 03/2024 | DOP | 194 982 | \$ | 3 409 | | 73 | | 0 | | 73 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 1 607 | PEN | 5 972 | | 2 | | 0 | | 2 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 406 | TRY | 12 738 | | 0 | | (5) | | (5) | 0,00 | |
| | 04/2024 | DOP | 78 670 | \$ | 1 368 | | 27 | | 0 | | 27 | 0,00 | |
| 04/2024 | \$ | 1 689 | EGP | 66 631 | | 0 | | (195) | | (195) | (0,01) | | |
| JPM | 01/2024 | HUF | 4 755 878 | \$ | 13 537 | | 0 | | (206) | | (206) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 801 | BRL | 3 957 | | 14 | | 0 | | 14 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 240 | MXN | 4 477 | | 23 | | 0 | | 23 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 3 111 | TRY | 92 344 | | 0 | | (8) | | (8) | 0,00 | |
| | 02/2024 | EGP | 43 975 | \$ | 1 262 | | 229 | | 0 | | 229 | 0,01 | |
| | 02/2024 | \$ | 7 978 | BRL | 39 131 | | 64 | | 0 | | 64 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 790 | EGP | 28 471 | | 0 | | (121) | | (121) | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 8 057 | INR | 673 050 | | 13 | | 0 | | 13 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 1 601 | TRY | 48 882 | | 0 | | (9) | | (9) | 0,00 | |
| | 03/2024 | AED | 26 039 | \$ | 7 095 | | 1 | | 0 | | 1 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CLP | 1 925 236 | | 2 135 | | 0 | | (61) | | (61) | 0,00 | |
| | 03/2024 | THB | 46 271 | | 1 302 | | 0 | | (63) | | (63) | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 22 756 | | 732 | | 0 | | (22) | | (22) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 314 | INR | 26 269 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 6 033 | EGP | 240 962 | | 0 | | (630) | | (630) | (0,02) | |
| | 06/2024 | KRW | 416 207 | \$ | 318 | | 0 | | (6) | | (6) | 0,00 | |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|------|
| MBC | 01/2024 | AUD | 1 187 | \$ 804 | \$ 0 | \$ (6) | \$ (6) | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 32 316 | 35 186 | 0 | (520) | (520) | (0,02) | |
| | 01/2024 | HUF | 1 455 505 | 3 922 | 0 | (272) | (272) | (0,01) | |
| | 01/2024 | ¥ | 390 000 | 2 732 | 0 | (37) | (37) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 722 | AUD 2 597 | 51 | 0 | 51 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 3 634 | CAD 4 930 | 106 | 0 | 106 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 359 | £ 1 079 | 16 | 0 | 16 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 514 | HUF 180 728 | 7 | 0 | 7 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 193 580 | \$ 10 129 | 0 | (444) | (444) | (0,02) | |
| | 02/2024 | ¥ | 800 000 | 5 635 | 0 | (74) | (74) | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 183 | EGP 6 596 | 0 | (28) | (28) | 0,00 | |
| | 03/2024 | PHP | 120 495 | \$ 2 153 | 0 | (22) | (22) | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 32 382 | 1 040 | 0 | (33) | (33) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 1 605 | INR 133 731 | 0 | (3) | (3) | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 830 | EGP 33 366 | 0 | (82) | (82) | 0,00 | |
| | MYI | 01/2024 | £ | 4 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 01/2024 | HUF | 927 336 | 2 636 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | | 01/2024 | MYR | 2 649 | 568 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | | 01/2024 | NZD | 848 | 528 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | | 01/2024 | PLN | 7 974 | 1 933 | 0 | (94) | (94) | 0,00 |
| 01/2024 | | \$ | 106 | € 96 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 1 945 | £ 1 523 | 0 | (3) | (3) | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 1 036 | HUF 365 230 | 17 | 0 | 17 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 685 | ¥ 100 951 | 32 | 0 | 32 | 0,00 | |
| 01/2024 | | | 1 618 | ZAR 29 717 | 5 | 0 | 5 | 0,00 | |
| 02/2024 | | EGP | 104 685 | \$ 2 991 | 531 | 0 | 531 | 0,02 | |
| 02/2024 | | \$ | 4 | CNY 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 02/2024 | | | 1 379 | EGP 49 859 | 0 | (208) | (208) | (0,01) | |
| 03/2024 | | IDR | 65 037 042 | \$ 4 225 | 8 | 0 | 8 | 0,00 | |
| 03/2024 | | \$ | 528 | CLP 463 045 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | | | 548 | EGP 19 629 | 0 | (96) | (96) | 0,00 | |
| 03/2024 | | | 510 | IDR 7 928 103 | 4 | 0 | 4 | 0,00 | |
| 04/2024 | | EGP | 51 122 | \$ 1 339 | 193 | 0 | 193 | 0,01 | |
| 04/2024 | | \$ | 624 | EGP 24 799 | 0 | (68) | (68) | 0,00 | |
| 06/2024 | | KRW | 152 116 | \$ 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| 06/2024 | \$ | 5 203 | £ 4 144 | 83 | 0 | 83 | 0,00 | | |
| RBC | 04/2024 | MXN | 808 | \$ 46 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| RYL | 01/2024 | AUD | 1 971 | 1 325 | 0 | (20) | (20) | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 99 | 110 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | NOK | 5 510 | 528 | 0 | (15) | (15) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 293 | NZD 2 114 | 45 | 0 | 45 | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | ¥ | 848 600 | \$ 5 903 | 0 | (120) | (120) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 95 | £ 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 36 | MYR 169 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 611 | TRY 18 080 | 0 | (2) | (2) | 0,00 | |
| | 02/2024 | MYR | 7 742 | \$ 1 692 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 409 | EGP 14 732 | 0 | (63) | (63) | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 1 675 | MYR 7 761 | 21 | 0 | 21 | 0,00 | |
| | 03/2024 | THB | 61 679 | \$ 1 784 | 0 | (35) | (35) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 522 | EGP 18 722 | 0 | (92) | (92) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 5 833 | IDR 90 207 345 | 17 | 0 | 17 | 0,00 | |
| 03/2024 | | 601 | INR 50 266 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | | |
| 04/2024 | | 1 158 | EGP 45 626 | 0 | (135) | (135) | (0,01) | | |
| SSB | 01/2024 | CLP | 3 769 579 | \$ 4 264 | 0 | (49) | (49) | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 27 996 464 | 1 799 | 0 | (16) | (16) | 0,00 | |
| TOR | 01/2024 | \$ | 1 132 | ¥ 166 016 | 47 | 0 | 47 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | € | 15 878 | \$ 17 416 | 0 | (128) | (128) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 11 770 | 14 895 | 0 | (110) | (110) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 573 | AUD 864 | 16 | 0 | 16 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 5 189 | IDR 80 299 109 | 24 | 0 | 24 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 2 787 | NOK 29 728 | 141 | 0 | 141 | 0,01 | |
| | 01/2024 | ZAR | 128 505 | \$ 6 732 | 0 | (286) | (286) | (0,01) | |
| | 03/2024 | CZK | 266 807 | 11 985 | 72 | 0 | 72 | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 80 342 700 | 5 189 | 0 | (20) | (20) | 0,00 | |
| | | | | \$ 7 375 | \$ (14 116) | \$ (6 741) | (0,25) | | |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| BPS | 01/2024 | CHF | 438 | \$ 513 | \$ 0 | \$ (8) | \$ (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 31 | CHF 27 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | | 31 373 | 27 364 | 1 156 | 0 | 1 156 | 0,05 |
| CBK | 01/2024 | CHF | 5 | \$ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 76 655 | CHF 66 784 | 2 736 | 0 | 2 736 | 0,10 |
| GLM | 01/2024 | CHF | 62 | \$ 71 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 86 733 | CHF 76 007 | 3 621 | 0 | 3 621 | 0,14 |
| MYI | 01/2024 | | 87 267 | 76 178 | 3 290 | 0 | 3 290 | 0,12 |
| SCX | 01/2024 | CHF | 12 | \$ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 106 | CHF 1 832 | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| | | | | \$ 10 876 | \$ (11) | \$ 10 865 | 0,41 | |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 3 077 | \$ 3 368 | \$ 1 | \$ (32) | \$ (31) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 468 808 | € 426 362 | 2 289 | (7) | 2 282 | 0,08 |
| BRC | 01/2024 | 403 846 | 367 206 | 1 882 | 0 | 1 882 | 0,07 |
| CBK | 01/2024 | € 13 429 | \$ 14 712 | 5 | (131) | (126) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 28 | € 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 27 200 | \$ 29 381 | 0 | (672) | (672) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 352 539 | € 322 415 | 3 700 | 0 | 3 700 | 0,14 |
| | | | | \$ 7 877 | \$ (842) | \$ 7 035 | 0,26 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 7 | \$ 9 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 440 | £ 7 451 | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 331 | \$ 418 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 197 | £ 6 462 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 165 | 130 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 684 | \$ 863 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ 66 | £ 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 4 355 | \$ 5 506 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 186 | £ 146 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 941 | \$ 1 184 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 365 | £ 286 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 47 462 | 37 523 | 374 | 0 | 374 | 0,02 |
| SSB | 01/2024 | £ 1 633 | \$ 2 055 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 29 123 | £ 23 080 | 300 | 0 | 300 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | £ 409 | \$ 512 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 47 451 | £ 37 494 | 348 | 0 | 348 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 124 | \$ (113) | \$ 1 011 | 0,04 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 109 | NOK 1 158 | \$ 5 | \$ 0 | \$ 5 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 123 | 1 316 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 176 | 1 880 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | | | | \$ 20 | \$ 0 | \$ 20 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Investisseurs en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | SEK 53 | \$ 5 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 732 | SEK 7 631 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | SEK 96 | \$ 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 129 | SEK 1 342 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SEK 49 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 14 | SEK 142 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SEK 46 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 21 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 812 | SEK 8 430 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK 59 | \$ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | \$ 934 | SEK 9 611 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | | | | \$ 75 | \$ 0 | \$ 75 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 11 759 0,44

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-----|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| CERTIFICATS DE DÉPÔT | | | | |
| Banco Davivienda S.A. | | | | |
| 10,942 % éch. 28/04/2026 | COP | 1 060 000 | \$ 276 | 0,01 |
| 11,679 % éch. 12/05/2025 | | 15 923 200 | 4 090 | 0,15 |
| 12,950 % éch. 08/03/2026 | | 11 878 809 | 3 189 | 0,12 |
| 13,183 % éch. 06/06/2026 | | 10 206 000 | 2 775 | 0,10 |
| 13,455 % éch. 13/06/2025 | | 6 749 000 | 1 796 | 0,07 |
| 13,456 % éch. 07/06/2025 | | 13 621 000 | 3 625 | 0,14 |
| 13,456 % éch. 09/06/2025 | | 4 550 000 | 1 211 | 0,05 |
| 13,501 % éch. 13/12/2024 | | 10 517 000 | 2 773 | 0,10 |
| 15,389 % éch. 21/02/2024 | | 3 593 000 | 938 | 0,04 |
| Bancolombia S.A. | | | | |
| 5,917 % éch. 27/01/2024 | | 16 789 000 | 4 334 | 0,16 |
| 10,388 % éch. 20/04/2026 | | 21 845 200 | 5 636 | 0,21 |
| 13,320 % éch. 08/06/2025 | | 5 439 000 | 1 430 | 0,05 |
| 13,456 % éch. 14/06/2025 | | 11 102 000 | 2 947 | 0,11 |
| 13,637 % éch. 14/12/2024 | | 14 365 000 | 3 762 | 0,14 |
| 16,137 % éch. 01/09/2024 | | 5 832 000 | 1 545 | 0,06 |
| BBVA Colombia S.A. | | | | |
| 13,093 % éch. 28/04/2026 | | 5 275 000 | 1 438 | 0,05 |
| 13,229 % éch. 10/05/2026 | | 2 290 000 | 627 | 0,02 |
| 13,365 % éch. 04/05/2026 | | 3 329 000 | 894 | 0,03 |
| 14,460 % éch. 13/01/2024 | | 7 110 900 | 1 829 | 0,07 |
| 16,412 % éch. 25/04/2024 | | 258 000 | 66 | 0,00 |
| Total des Certificats de dépôt | | | \$ 45 181 | 1,68 |
| Total des Investissements | | | \$ 2 916 581 | 108,27 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | \$ (222 660) | (8,27) |
| Actifs nets | | | \$ 2 693 921 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Titre convertible conditionnel.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,64 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|---------|--------------------|-----------------|-----------|-----------------|------------------------|
| Banque de développement d'Afrique du Sud | 8,600 % | 21/10/2024 | 07/10/2021 | \$ 17 010 | \$ 13 808 | 0,51 |

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 228 436 \$ (31 décembre 2022 : 38 910 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 300 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 55 830 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 301 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 6 296 \$ (31 décembre 2022 : 807 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 19 878 \$ (31 décembre 2022 : 18 655 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 3 680 \$ (31 décembre 2022 : 6 470 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques | | | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|----------------|--|--|---|---------------------|
| | (Niveau 1) | | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ | 0 | | \$ 2 794 082 | \$ 39 430 | \$ 2 833 512 |
| Contrats de mise en pension | | 0 | | 13 694 | 0 | 13 694 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | | (3 078) | | 27 272 | 0 | 24 194 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | | 0 | | 45 181 | 0 | 45 181 |
| Totaux | \$ | (3 078) | | \$ 2 880 229 | \$ 39 430 | \$ 2 916 581 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques | | | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--------------|--|--|---|---------------------|
| | (Niveau 1) | | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ | 0 | | \$ 2 396 551 | \$ 25 705 | \$ 2 422 256 |
| Contrats de mise en pension | | 0 | | 44 661 | 0 | 44 661 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | | 5 273 | | 27 624 | (11) | 32 886 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | | 0 | | 0 | 1 659 | 1 659 |
| Totaux | \$ | 5 273 | | \$ 2 468 836 | \$ 27 353 | \$ 2 501 462 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | | |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|--------------------------|--|---------------------|--------|
| | | | | | En % de l'actif net | En % de l'actif net | |
| BPS | 4,050 % | 28/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (329) | \$ (333) | (0,01) | |
| | 4,150 | 20/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (19 570) | (21 868) | (0,81) | |
| | 4,300 | 22/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (2 523) | (2 535) | (0,09) | |
| | 4,500 | 22/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 249) | (1 255) | (0,05) | |
| | 5,000 | 13/10/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (2 293) | (2 315) | (0,09) | |
| | 5,400 | 10/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | £ (3 224) | (4 142) | (0,15) | |
| | 5,520 | 19/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (9 581) | (9 600) | (0,36) | |
| | 9,000 | 11/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | ZAR (586 920) | (32 258) | (1,20) | |
| | BRC | 4,500 | 11/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (2 609) | (2 615) | (0,10) |
| | | 4,750 | 19/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (2 557) | (2 592) | (0,10) |
| 4,750 | | 11/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (8 000) | (8 022) | (0,30) | |
| 4,750 | | 12/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 747) | (1 751) | (0,06) | |
| 4,750 | | 19/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (2 297) | (2 301) | (0,09) | |
| BSN | 5,510 | 14/12/2023 | 04/01/2024 | (15 401) | (15 443) | (0,57) | |
| MYI | 3,750 | 01/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (657) | (662) | (0,02) | |
| | 4,000 | 28/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (2 790) | (2 819) | (0,10) | |
| | 4,000 | 13/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (10 374) | (10 431) | (0,39) | |
| | 4,000 | 29/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 734) | (1 740) | (0,06) | |
| | 4,200 | 05/05/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 518) | (1 552) | (0,06) | |
| | 4,200 | 06/07/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (3 759) | (3 837) | (0,14) | |
| | 4,650 | 25/10/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 063) | (1 071) | (0,04) | |
| | 4,100 | 02/08/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (1 477) | (1 658) | (0,06) | |
| SCX | 4,100 | 10/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (40 343) | (44 826) | (1,66) | |
| | 4,140 | 10/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (3 036) | (3 374) | (0,13) | |
| | 5,490 | 11/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (35 719) | (35 833) | (1,33) | |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (214 833) | (7,97) | |

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos ⁽¹⁾ | |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| | | | | | En % de l'actif net | En % de l'actif net |
| BRC | 5,730 % | 28/12/2023 | 02/01/2024 | \$ (44 855) | \$ (44 884) | (1,66) |
| GSC | 5,530 | 18/12/2023 | 04/01/2024 | (11 756) | (11 781) | (0,44) |
| Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (56 665) | (2,10) |

(1) Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 13 \$ de baisse de prix différée.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 46 | \$ 0 | \$ 46 | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | (842) | 1 300 | 458 | 5 | 0 | 5 |
| BPS | 501 | (3 470) | (2 969) | (1 369) | 2 060 | 691 |
| BRC | 1 850 | (2 610) | (760) | (218) | 320 | 102 |
| CBK | 2 051 | (2 440) | (389) | 22 572 | (21 703) | 869 |
| DUB | 1 098 | (740) | 358 | (250) | 270 | 20 |
| FBF | S/O | S/O | S/O | (5) | 0 | (5) |
| GLM | 2 503 | (2 430) | 73 | 619 | (580) | 39 |
| GST | (1 574) | 1 570 | (4) | (2 119) | 2 110 | (9) |
| HUS | S/O | S/O | S/O | 1 | 0 | 1 |
| JPM | (871) | 810 | (61) | (645) | 680 | 35 |
| MBC | 1 641 | (3 320) | (1 679) | 5 068 | (4 320) | 748 |
| MYC | 1 203 | (1 190) | 13 | (538) | 760 | 222 |
| MYI | 3 748 | (4 290) | (542) | 23 | 0 | 23 |
| RBC | (1) | 0 | (1) | (189) | 0 | (189) |
| RYL | 11 | 0 | 11 | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 64 | (310) | (246) | 9 690 | (9 190) | 500 |
| SOG | S/O | S/O | S/O | (20) | 0 | (20) |
| SSB | 208 | (360) | (152) | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 47 | 0 | 47 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 76 | 0 | 76 | (311) | 270 | (41) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 93,42 | 84,95 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 11,74 | 12,05 |
| Autres valeurs mobilières | 0,01 | 0,17 |
| Contrats de mise en pension | 0,51 | 1,79 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,33 | 0,04 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,14 | (0,02) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,44 | 1,30 |
| Certificats de dépôt | 1,68 | 0,07 |
| Contrats de prise en pension | (7,97) | (1,56) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (2,10) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Argentine | 2,10 | 1,90 |
| Arménie | 0,24 | 0,27 |
| Bahamas | 0,16 | 0,33 |
| Bahreïn | 0,97 | 0,93 |
| Bénin | 0,59 | 0,36 |
| Bermudes | 0,13 | 0,13 |
| Brésil | 2,40 | 3,00 |
| Bulgarie | 0,53 | S/O |
| Îles Caïmans | 2,32 | 2,06 |
| Chili | 3,07 | 2,80 |
| Chine | 0,00 | 0,01 |
| Colombie | 3,17 | 2,57 |
| Costa Rica | 1,00 | 1,12 |
| Chypre | 0,26 | 0,24 |
| République dominicaine | 4,46 | 2,95 |
| Équateur | 1,87 | 2,19 |
| Égypte | 2,63 | 2,28 |
| Salvador | 0,87 | 0,48 |
| France | S/O | 0,10 |
| Gabon | 0,02 | S/O |
| Géorgie | 0,37 | 0,39 |
| Allemagne | S/O | 0,02 |
| Ghana | 1,29 | 1,16 |
| Guernesey, Îles Anglo-normandes | 0,12 | 0,12 |
| Hong Kong | 1,70 | 1,28 |
| Hongrie | 3,71 | 2,09 |
| Inde | 1,43 | 1,69 |
| Indonésie | 2,70 | 2,63 |
| Internationales | 0,20 | S/O |
| Irlande | 0,02 | 0,08 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Israël | S/O | 2,24 |
| Côte d'Ivoire | 0,95 | 1,27 |
| Jamaïque | 0,15 | 0,17 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,46 | 0,48 |
| Jordanie | 0,68 | 0,38 |
| Kazakhstan | 0,93 | 1,46 |
| Kenya | 0,39 | 0,54 |
| Luxembourg | 0,52 | 0,36 |
| Macédoine du Nord | 0,42 | S/O |
| Malaisie | 0,49 | 0,13 |
| Île Maurice | 0,35 | 0,85 |
| Mexique | 4,83 | 2,31 |
| Mongolie | 0,31 | 0,65 |
| Maroc | 0,66 | 0,77 |
| Multinationales | 0,02 | 0,02 |
| Namibie | 0,08 | 0,09 |
| Pays-Bas | 1,24 | 0,87 |
| Oman | 2,80 | 3,07 |
| Pakistan | 0,44 | S/O |
| Panama | 3,08 | 2,85 |
| Paraguay | 0,93 | 0,91 |
| Pérou | 1,31 | 1,36 |
| Philippines | 1,39 | 1,24 |
| Pologne | 1,26 | 0,40 |
| Qatar | 1,37 | 1,81 |
| Roumanie | 3,48 | 2,26 |
| Russie | 0,01 | 0,04 |
| Sénégal | 0,59 | 0,41 |
| Serbie | 1,63 | 0,84 |
| Singapour | 0,40 | 0,43 |
| Slovénie | 0,34 | S/O |
| Afrique du Sud | 2,81 | 3,59 |
| Corée du Sud | 5,62 | 4,60 |
| Espagne | 0,35 | 0,38 |
| Sri Lanka | 0,98 | 0,67 |
| Supranationales | 1,22 | 1,81 |
| Suisse | 0,43 | 0,58 |
| Tanzanie | 0,94 | 0,24 |
| Trinité-et-Tobago | 0,17 | S/O |
| Tunisie | 0,62 | 0,34 |
| Turquie | 2,56 | 2,08 |
| Ukraine | 0,99 | 0,78 |
| Émirats arabes unis | 3,03 | 1,00 |
| Royaume-Uni | 1,17 | 1,65 |
| États-Unis | 10,31 | 7,06 |
| Uruguay | 1,89 | 1,65 |
| Ouzbékistan | 0,11 | 0,03 |
| Vietnam | 0,04 | 0,04 |
| Îles Vierges britanniques | 0,23 | 0,73 |
| Zambie | 0,01 | 0,12 |
| Instruments à court terme | 1,85 | 8,43 |
| Contrats de mise en pension | 0,51 | 1,79 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,33 | 0,04 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,14 | (0,02) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Options de change | 0,00 | S/O |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,09) | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,07 | (0,18) |
| Swaps de volatilité | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,25) | 0,21 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,71 | 1,27 |
| Certificats de dépôt | 1,68 | 0,07 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (8,27) | (0,35) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | VALEURS MOBILIÈRES | | | | VALEURS MOBILIÈRES | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | |
| Ecopetrol S.A. TBD % éch. 17/08/2024 | \$ 1 000 | \$ 982 | 0,62 | Gaci First Investment Co. 5,125 % éch. 14/02/2053 | \$ 500 | \$ 454 | 0,29 | Sunac China Holdings Ltd. 6,000 % éch. 30/09/2026 | \$ 40 | \$ 4 | 0,00 |
| République de Côte d'Ivoire 9,055 % éch. 19/03/2027 | € 700 | 746 | 0,48 | GLP Pte. Ltd. 3,875 % éch. 04/06/2025 | 200 | 133 | 0,08 | 6,250 % éch. 30/09/2027 | 40 | 3 | 0,00 |
| SOCAR Turkey Enerji A/S 7,387 % éch. 11/08/2026 | 1 000 | 1 091 | 0,69 | 4,500 % éch. 17/05/2026 (e) | 300 | 96 | 0,06 | 6,500 % éch. 30/09/2027 | 80 | 6 | 0,00 |
| | | 2 819 | 1,79 | Goldman Sachs Group, Inc. 3,272 % éch. 29/09/2025 | 500 | 492 | 0,31 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | 120 | 5 | 0,00 |
| | | | | Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. 9,620 % éch. 28/06/2018 | MXN 34 709 | 0 | 0,00 | 7,000 % éch. 30/09/2029 | 120 | 6 | 0,00 |
| | | | | Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % éch. 24/02/2030 | \$ 200 | 166 | 0,11 | 7,250 % éch. 30/09/2030 | 56 | 2 | 0,00 |
| | | | | IIRSA Norte Finance Ltd. 8,750 % éch. 30/05/2024 | 3 | 3 | 0,00 | Trust Fibra Uno 6,390 % éch. 15/01/2050 | 600 | 486 | 0,31 |
| | | | | Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % éch. 21/01/2032 | 800 | 719 | 0,46 | WE Soda Investments Holding PLC 9,500 % éch. 06/10/2028 | 400 | 414 | 0,26 |
| | | | | Interoceanic Finance Ltd. 0,000 % éch. 30/11/2025 (c) | 20 | 18 | 0,01 | Wells Fargo & Co. 2,406 % éch. 30/10/2025 | 500 | 487 | 0,31 |
| | | | | Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % éch. 30/06/2024 ^ | 300 | 11 | 0,01 | Yango Justice International Ltd. 7,500 % éch. 17/02/2025 ^ | 400 | 4 | 0,00 |
| | | | | 9,750 % éch. 28/09/2023 ^ | 1 400 | 51 | 0,03 | 7,875 % éch. 04/09/2024 ^ | 200 | 1 | 0,00 |
| | | | | Kasikornbank PCL 3,343 % éch. 02/10/2031 (g) | 600 | 552 | 0,35 | Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % éch. 20/05/2026 | 400 | 233 | 0,15 |
| | | | | Kookmin Bank 2,500 % éch. 04/11/2030 (g) | 1 100 | 917 | 0,58 | Yapi ve Kredi Bankasi A/S 9,250 % éch. 16/10/2028 | 1 000 | 1 062 | 0,67 |
| | | | | Kuwait Projects Co. SPC Ltd. 4,500 % éch. 23/02/2027 | 482 | 425 | 0,27 | | 39 725 | 25,19 | |
| | | | | Longfor Group Holdings Ltd. 4,500 % éch. 16/01/2028 | 200 | 104 | 0,07 | INDUSTRIE | | | |
| | | | | MDGH GMTN RSC Ltd. 5,500 % éch. 28/04/2033 | 300 | 319 | 0,20 | Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % éch. 12/02/2030 | 349 | 286 | 0,18 |
| | | | | NBK SPC Ltd. 1,625 % éch. 15/09/2027 | 2 000 | 1 813 | 1,15 | Alfa Desarrollo SpA 4,550 % éch. 27/09/2051 | 994 | 777 | 0,49 |
| | | | | NE Property BV 1,875 % éch. 09/10/2026 | € 500 | 506 | 0,32 | ALROSA Finance S.A. 3,100 % éch. 25/06/2027 ^ | 1 100 | 66 | 0,04 |
| | | | | 2,000 % éch. 20/01/2030 | 100 | 89 | 0,06 | Andrade Gutierrez International S.A. 9,000 % éch. 28/12/2029 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029 | 400 | 391 | 0,25 | AngloGold Ashanti Holdings PLC 3,375 % éch. 01/11/2028 | 200 | 180 | 0,11 |
| | | | | NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % éch. 10/03/2028 (e) | \$ 200 | 109 | 0,07 | 3,750 % éch. 01/10/2030 | 300 | 261 | 0,17 |
| | | | | 6,250 % éch. 07/03/2024 (e) | 200 | 108 | 0,07 | 6,500 % éch. 15/04/2040 | 500 | 491 | 0,31 |
| | | | | OEC Finance Ltd. (4,375 % en numéraire ou 4,375 % de rémunération en nature) | 765 | 38 | 0,02 | Antofagasta PLC 2,375 % éch. 14/10/2030 | 700 | 574 | 0,36 |
| | | | | 4,375 % éch. 25/10/2029 (a) | 765 | 38 | 0,02 | 5,625 % éch. 13/05/2032 | 200 | 201 | 0,13 |
| | | | | OEC Finance Ltd. (5,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature) | 473 | 20 | 0,01 | Arcelik A/S 8,500 % éch. 25/09/2028 | 300 | 317 | 0,20 |
| | | | | 5,250 % éch. 27/12/2033 (a) | 473 | 20 | 0,01 | ATP Tower Holdings LLC 4,050 % éch. 27/04/2026 | 500 | 455 | 0,29 |
| | | | | OEC Finance Ltd. (7,125 % en numéraire ou 7,125 % de rémunération en nature) | 1 739 | 109 | 0,07 | Axiata SPV2 Bhd. 2,163 % éch. 19/08/2030 | 300 | 256 | 0,16 |
| | | | | 7,125 % éch. 26/12/2046 (a) | 1 739 | 109 | 0,07 | Axiata SPV5 Labuan Ltd. 3,064 % éch. 19/08/2050 | 500 | 346 | 0,22 |
| | | | | OTP Bank Nyrt 8,750 % éch. 15/05/2033 | 200 | 206 | 0,13 | Bimbo Bakeries USA, Inc. 6,050 % éch. 15/01/2029 | 400 | 421 | 0,27 |
| | | | | Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % éch. 30/04/2025 ^ | 1 300 | 115 | 0,07 | Braskem Netherlands Finance BV 8,500 % éch. 12/01/2031 | 400 | 373 | 0,24 |
| | | | | QNB Finance Ltd. 1,375 % éch. 26/01/2026 | 1 400 | 1 295 | 0,82 | Canacol Energy Ltd. 5,750 % éch. 24/11/2028 | 700 | 511 | 0,32 |
| | | | | 2,625 % éch. 12/05/2025 | 500 | 481 | 0,31 | Celulosa Arauco y Constitucion S.A. 5,500 % éch. 30/04/2049 | 700 | 605 | 0,38 |
| | | | | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,250 % éch. 23/05/2023 | 1 700 | 102 | 0,06 | Champion Path Holdings Ltd. 4,850 % éch. 27/01/2028 | 200 | 172 | 0,11 |
| | | | | ^(g) | 1 700 | 102 | 0,06 | China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % éch. 14/07/2026 | 600 | 533 | 0,34 |
| | | | | Seazen Group Ltd. 4,450 % éch. 13/07/2025 | 1 000 | 295 | 0,19 | CK Hutchison International Ltd. 4,750 % éch. 21/04/2028 | 500 | 501 | 0,32 |
| | | | | Shinhan Bank Co. Ltd. 4,500 % éch. 26/03/2028 (g) | 900 | 870 | 0,55 | Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) | 310 | 225 | 0,14 |
| | | | | Shinhan Card Co. Ltd. 2,500 % éch. 27/01/2027 | 500 | 462 | 0,29 | Corp. GEO S.A.B. de C.V. 8,875 % éch. 25/09/2014 ^ | 850 | 0 | 0,00 |
| | | | | Shinhan Financial Group Co. Ltd. 5,000 % éch. 24/07/2028 | 700 | 700 | 0,44 | CSN Inova Ventures 6,750 % éch. 28/01/2028 | 700 | 684 | 0,43 |
| | | | | Shriram Finance Ltd. 4,150 % éch. 18/07/2025 | 327 | 314 | 0,20 | CSN Resources S.A. 8,875 % éch. 05/12/2030 | 300 | 313 | 0,20 |
| | | | | SNB Funding Ltd. 2,900 % éch. 29/01/2027 | 1 700 | 1 596 | 1,01 | CT Trust 5,125 % éch. 03/02/2032 | 1 000 | 875 | 0,56 |
| | | | | Sovcombank Via SovCom Capital DAC 3,400 % éch. 26/01/2025 ^ | 1 100 | 30 | 0,02 | Ecopetrol S.A. 6,875 % éch. 29/04/2030 | 1 800 | 1 786 | 1,13 |
| | | | | Standard Chartered PLC 6,170 % éch. 09/01/2027 | 500 | 508 | 0,32 | 7,375 % éch. 18/09/2043 | 800 | 764 | 0,48 |
| | | | | 7,767 % éch. 16/11/2028 | 700 | 756 | 0,48 | | | | |
| | | | | Suci Second Investment Co. 6,000 % éch. 25/10/2028 | 500 | 529 | 0,34 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Endeavour Mining PLC 5,000 % éch. 14/10/2026 | 300 | 278 | 0,18 | MGM China Holdings Ltd. 5,375 % éch. 15/05/2024 | 800 | 797 | 0,51 | Telecomunicaciones Digitales S.A. 4,500 % éch. 30/01/2030 | 300 | 259 | 0,16 |
| Energian Israel Finance Ltd. 5,375 % éch. 30/03/2028 | 700 | 617 | 0,39 | Nakilat, Inc. 6,067 % éch. 31/12/2033 | 345 | 357 | 0,23 | Telefonica Celular del Paraguay S.A. 5,875 % éch. 15/04/2027 | 600 | 585 | 0,37 |
| First Quantum Minerals Ltd. 6,875 % éch. 15/10/2027 | 700 | 596 | 0,38 | OAS Restructuring BVI Ltd. 5,000 % éch. 31/03/2035 (h) | 475 | 5 | 0,00 | Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % éch. 15/08/2030 | 700 | 578 | 0,37 |
| Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % éch. 02/10/2026 | 200 | 141 | 0,09 | OCP S.A. 5,125 % éch. 23/06/2051 | 1 400 | 1 066 | 0,68 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,750 % éch. 09/05/2027 | 1 900 | 2 029 | 1,29 |
| 5,950 % éch. 19/10/2025 | 300 | 250 | 0,16 | 6,875 % éch. 25/04/2044 | 500 | 476 | 0,30 | TMS Issuer SARL 5,780 % éch. 23/08/2032 | 200 | 209 | 0,13 |
| Freeport Indonesia PT 4,763 % éch. 14/04/2027 | 900 | 889 | 0,56 | Odebrecht Holdco Finance Ltd. 0,000 % éch. 10/09/2058 (c) | 3 424 | 3 | 0,00 | Turkish Airlines Pass-Through Trust 4,200 % éch. 15/09/2028 | 578 | 547 | 0,35 |
| 6,200 % éch. 14/04/2052 | 800 | 795 | 0,50 | Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. 0,000 % éch. 29/01/2024 (c)(e) | 1 416 | 49 | 0,03 | Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % éch. 01/10/2026 ^A | 900 | 248 | 0,16 |
| Fresnillo PLC 4,250 % éch. 02/10/2050 | 800 | 612 | 0,39 | ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd. 3,750 % éch. 27/07/2026 | 1 000 | 967 | 0,61 | Vale Overseas Ltd. 3,750 % éch. 08/07/2030 | 400 | 369 | 0,23 |
| GEMS MENASA Cayman Ltd. 7,125 % éch. 31/07/2026 | 200 | 197 | 0,13 | Periama Holdings LLC 5,950 % éch. 19/04/2026 | 300 | 296 | 0,19 | 6,875 % éch. 21/11/2036 | 700 | 765 | 0,49 |
| Geopark Ltd. 5,500 % éch. 17/01/2027 | 300 | 266 | 0,17 | Pertamina Persero PT 5,625 % éch. 20/05/2043 | 800 | 811 | 0,51 | Vale S.A. 0,000 % (e) | BRL 6 700 | 489 | 0,31 |
| Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. 6,125 % éch. 15/05/2029 | 700 | 719 | 0,46 | Petron Corp. 5,950 % éch. 19/04/2026 (e) | 300 | 281 | 0,18 | Wynn Macau Ltd. 4,875 % éch. 01/10/2024 | 500 | 494 | 0,31 |
| Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % éch. 23/02/2038 | 500 | 522 | 0,33 | Petronas Capital Ltd. 3,404 % éch. 28/04/2061 | 700 | 504 | 0,32 | 5,500 % éch. 15/01/2026 | 500 | 488 | 0,31 |
| 6,510 % éch. 23/02/2042 | 200 | 212 | 0,13 | Petrório Luxembourg Trading SARL 6,125 % éch. 09/06/2026 | 500 | 491 | 0,31 | YPF S.A. 6,950 % éch. 21/07/2027 | 800 | 717 | 0,45 |
| Grupo Bimbo S.A.B. de C.V. 4,000 % éch. 06/09/2049 | 500 | 404 | 0,26 | Prosus NV 3,061 % éch. 13/07/2031 | 1 300 | 1 051 | 0,67 | Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % éch. 19/08/2025 | 500 | 457 | 0,29 |
| Guara Norte SARL 5,198 % éch. 15/06/2034 | 857 | 781 | 0,50 | 3,257 % éch. 19/01/2027 | 200 | 185 | 0,12 | Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % éch. 13/01/2026 | 700 | 653 | 0,41 |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. 5,000 % éch. 27/07/2028 | 200 | 202 | 0,13 | 4,987 % éch. 19/01/2052 | 1 000 | 753 | 0,48 | | | | |
| Health & Happiness International Holdings Ltd. 13,500 % éch. 26/06/2026 | 800 | 774 | 0,49 | Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 6,332 % éch. 30/09/2027 | 517 | 528 | 0,33 | | | | |
| Hikma Finance USA LLC 3,250 % éch. 09/07/2025 | 1 000 | 960 | 0,61 | Rede D'or Finance SARL 4,500 % éch. 22/01/2030 | 713 | 646 | 0,41 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | |
| Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru 8,550 % éch. 18/09/2033 | 400 | 438 | 0,28 | Reliance Industries Ltd. 2,875 % éch. 12/01/2032 | 900 | 772 | 0,49 | C&W Senior Financing DAC 6,875 % éch. 15/09/2027 | 200 | 187 | 0,12 |
| IHS Netherlands Holdco BV 8,000 % éch. 18/09/2027 | 760 | 679 | 0,43 | ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027 | 700 | 670 | 0,43 | Chile Electricity Lux MPC SARL 6,010 % éch. 20/01/2033 | 600 | 616 | 0,39 |
| Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3,398 % éch. 09/06/2031 | 500 | 433 | 0,27 | Sable International Finance Ltd. 5,750 % éch. 07/09/2027 | 200 | 189 | 0,12 | Cikarang Listrindo Tbk PT 4,950 % éch. 14/09/2026 | 500 | 481 | 0,31 |
| Industrias Penoles S.A.B. de C.V. 4,750 % éch. 06/08/2050 | 800 | 645 | 0,41 | Sands China Ltd. 3,100 % éch. 08/03/2029 | 300 | 262 | 0,17 | Empresa Electrica Cochran SpA 5,500 % éch. 14/05/2027 | 157 | 149 | 0,09 |
| InRetail Consumer 3,250 % éch. 22/03/2028 | 1 200 | 1 078 | 0,68 | 4,300 % éch. 08/01/2026 | 200 | 192 | 0,12 | EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031 | € 500 | 429 | 0,27 |
| Invepar Holdings LLC 1,000 % éch. 31/12/2049 (h) | 210 | 0 | 0,00 | 4,625 % éch. 18/06/2030 | 450 | 410 | 0,26 | Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % éch. 29/01/2025 | \$ 700 | 687 | 0,44 |
| Inversiones CMPC S.A. 3,000 % éch. 06/04/2031 | 500 | 426 | 0,27 | 5,375 % éch. 08/08/2025 | 300 | 296 | 0,19 | IHS Holding Ltd. 5,625 % éch. 29/11/2026 | 400 | 349 | 0,22 |
| JSW Steel Ltd. 5,050 % éch. 05/04/2032 | 600 | 517 | 0,33 | 5,650 % éch. 08/08/2028 | 1 700 | 1 687 | 1,07 | India Green Energy Holdings 5,375 % éch. 29/04/2024 | 250 | 248 | 0,16 |
| KazMunayGas National Co. JSC 5,750 % éch. 19/04/2047 | 200 | 176 | 0,11 | Sasol Financing USA LLC 5,875 % éch. 27/03/2024 | 500 | 497 | 0,32 | Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % éch. 22/02/2032 | 200 | 170 | 0,11 |
| 6,375 % éch. 24/10/2048 | 1 500 | 1 416 | 0,90 | 6,500 % éch. 27/09/2028 | 1 700 | 1 621 | 1,03 | 4,250 % éch. 14/08/2028 | 1 600 | 1 501 | 0,95 |
| Kosmos Energy Ltd. 7,125 % éch. 04/04/2026 | 810 | 771 | 0,49 | Saudi Arabian Oil Co. 2,250 % éch. 24/11/2030 | 1 600 | 1 378 | 0,87 | Korea Southern Power Co. Ltd. 5,375 % éch. 21/09/2026 | 400 | 404 | 0,26 |
| 7,750 % éch. 01/05/2027 | 200 | 187 | 0,12 | 4,250 % éch. 16/04/2039 | 1 500 | 1 345 | 0,85 | LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % éch. 04/02/2039 | 644 | 621 | 0,39 |
| Lenovo Group Ltd. 3,421 % éch. 02/11/2030 (i) | 900 | 795 | 0,50 | Seplat Energy PLC 7,750 % éch. 01/04/2026 | 400 | 369 | 0,23 | Medco Maple Tree Pte Ltd. 8,960 % éch. 27/04/2029 | 1 000 | 1 017 | 0,64 |
| Leviathan Bond Ltd. 6,500 % éch. 30/06/2027 | 800 | 755 | 0,48 | Severstal OAO Via Steel Capital S.A. 3,150 % éch. 16/09/2024 ^ | 800 | 38 | 0,02 | MSU Energy S.A. 6,875 % éch. 01/02/2025 | 400 | 306 | 0,19 |
| LG Energy Solution Ltd. 5,750 % éch. 25/09/2028 | 400 | 413 | 0,26 | Sítios Latinoamerica S.A.B. de C.V. 5,375 % éch. 04/04/2032 | 900 | 837 | 0,53 | Peru LNG SRL 5,375 % éch. 22/03/2030 | 500 | 414 | 0,26 |
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. 4,875 % éch. 25/07/2033 | 800 | 794 | 0,50 | SK Hynix, Inc. 2,375 % éch. 19/01/2031 | 800 | 649 | 0,41 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5,250 % éch. 24/10/2042 | 300 | 284 | 0,18 |
| Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % éch. 14/05/2026 | 700 | 696 | 0,44 | 6,375 % éch. 17/01/2028 | 400 | 413 | 0,26 | Rio Oil Finance Trust 8,200 % éch. 06/04/2028 | 825 | 845 | 0,54 |
| Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % éch. 06/06/2025 | 600 | 582 | 0,37 | SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026 | 700 | 705 | 0,45 | 9,750 % éch. 06/01/2027 | 443 | 462 | 0,29 |
| 5,375 % éch. 04/12/2029 | 400 | 354 | 0,22 | SMC Global Power Holdings Corp. 5,450 % éch. 09/12/2026 (e) | 400 | 320 | 0,20 | Saudi Electricity Sukuk Programme Co. 5,684 % éch. 11/04/2053 | 400 | 411 | 0,26 |
| 5,625 % éch. 17/07/2027 | 400 | 375 | 0,24 | Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. 6,500 % éch. 07/11/2033 | 600 | 638 | 0,40 | Southern Gas Corridor CJSC 6,875 % éch. 24/03/2026 | 400 | 407 | 0,26 |
| 5,750 % éch. 21/07/2028 | 400 | 371 | 0,24 | Stillwater Mining Co. 4,000 % éch. 16/11/2026 | 1 000 | 892 | 0,57 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % éch. 24/04/2033 | 405 | 406 | 0,26 |
| Mersin Ululararasi Liman Isletmeciligi A/S 8,250 % éch. 15/11/2028 | 700 | 732 | 0,46 | Studio City Co. Ltd. 7,000 % éch. 15/02/2027 | 800 | 787 | 0,50 | | | | |
| Metalsa S.A. de C.V. 3,750 % éch. 04/05/2031 | 800 | 659 | 0,42 | Suzano Austria GmbH 3,125 % éch. 15/01/2032 | 500 | 415 | 0,26 | Total Obligations et billets privés | 119 287 | 75,63 | |
| Metinvest BV 5,625 % éch. 17/06/2025 | 550 | 480 | 0,30 | 3,750 % éch. 15/01/2031 | 300 | 263 | 0,17 | | | | |
| 6,067 % éch. 31/12/2033 | 345 | 357 | 0,23 | TAV Havalimanlari Holding A/S 8,500 % éch. 07/12/2028 | 400 | 410 | 0,26 | | | | |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | | | | | | | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------------|---|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|---|------------------------------------|-----|---|------|------|------------|-------|------|--|
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | | | | | | IMMOBILIER | | | | | | | | | | | | | | |
| Sunac China Holdings Ltd. 1,000 % éch. 30/09/2032 | \$ | 69 | 5 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement chilien 4,340 % éch. 07/03/2042 | \$ | 900 | 807 | 0,51 | Sunac Services Holdings Ltd. | 321 644 | \$ | 77 | 0,05 | | | | | | | | |
| Wynn Macau Ltd. 4,500 % éch. 07/03/2029 | | 400 | 410 | 0,26 | Obligation internationale du gouvernement colombien 4,500 % éch. 28/01/2026 | | 1 000 | 986 | 0,63 | | | | 412 | 0,26 | | | | | | | | |
| | | | 415 | 0,26 | Billets de la Banque centrale de République dominicaine 13,000 % éch. 05/12/2025 DOP | | 25 900 | 468 | 0,30 | BONS DE SOUSCRIPTION | | | | | | | | | | | | |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | | | | | OAS S.A. - Exp. 21/01/2039 (h) | | | | | | | | | | | | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | | | | | 175 616 | | | | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 4,000 % éch. 01/02/2054 | | 450 | 426 | 0,27 | Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | | 5,300 % éch. 21/01/2041 | \$ | 200 | 174 | 0,11 | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | | | | | | | | |
| 4,500 % éch. 01/02/2054 | | 450 | 437 | 0,28 | 7,050 % éch. 03/02/2031 | | 7,050 % éch. 03/02/2031 | | 200 | 210 | 0,13 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | | | | | | | |
| 5,000 % éch. 01/02/2054 | | 2 050 | 2 029 | 1,28 | 11,250 % éch. 15/09/2035 DOP | | 11,250 % éch. 15/09/2035 DOP | | 44 200 | 824 | 0,52 | BILLETS À COURT TERME | | | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 01/02/2054 | | 550 | 552 | 0,35 | Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 6,000 % éch. 31/07/2030 | | 6,000 % éch. 31/07/2030 | | \$ | 100 | 47 | 0,03 | Digicel International Finance Ltd. 8,750 % éch. 25/05/2024 | | | | | | | | | |
| | | | 3 444 | 2,18 | Export-Credit Bank of Turkey 9,375 % éch. 31/01/2026 | | 9,375 % éch. 31/01/2026 | | | 900 | 943 | 0,60 | \$ | 145 | 136 | 0,09 | | | | | | |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | | | | | Banque de développement hongroise 6,500 % éch. 29/06/2028 | | | | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | | | | | | | |
| Obligations du Trésor américain 3,000 % éch. 15/05/2045 | | | | | | | | 200 | | | | 206 | 0,13 | 10,900 % éch. 04/01/2024 (c)(d) | | | | | | | | |
| | | 8 000 | 6 603 | 4,19 | Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | | 5,000 % éch. 30/10/2026 | | € | 400 | 452 | 0,29 | HUF 275 000 | | | 794 | 0,50 | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | | Korea Electric Power Corp. 5,375 % éch. 31/07/2026 | | | | BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | | | | | | | | |
| Canada Square Funding PLC 6,070 % éch. 17/01/2059 | | | | | | | | 5,375 % éch. 31/07/2026 | | | | | | | | (0,210) % éch. 29/01/2024 (c)(d) | | | | | | |
| | £ | 83 | 105 | 0,06 | Magyar Export-Import Bank 6,000 % éch. 16/05/2029 | | 6,000 % éch. 16/05/2029 | | \$ | 300 | 303 | 0,19 | ¥ 360 000 | | | 2 554 | 1,62 | | | | | |
| Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 5,700 % éch. 25/10/2035 | | | | | | | | Émission d'investissement du gouvernement malaisien 3,465 % éch. 15/10/2030 | | | | | | | | (0,190) % éch. 10/01/2024 (c)(d) | | | | | | |
| | \$ | 373 | 343 | 0,22 | | | | | MY | | 100 | 118 | 0,08 | 20 000 | | | 142 | 0,09 | | | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust 4,546 % éch. 25/08/2036 | | | | | | | | 2,245 % éch. 30/09/2030 | | | | | | | | 50 000 | | | 355 | 0,22 | | |
| | | 249 | 218 | 0,14 | Obligation internationale du gouvernement panaméen 6,875 % éch. 31/01/2036 | | 6,875 % éch. 31/01/2036 | | R | 220 | 47 | 0,03 | 3 051 | | | 1,93 | | | | | | |
| Countrywide Alternative Loan Trust 6,112 % éch. 20/12/2035 | | | | | | | | Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033 | | | | | | | | 3 110 | | | 675 | 0,43 | | |
| | | 46 | 42 | 0,03 | Obligation internationale du gouvernement roumain 2,000 % éch. 14/04/2033 | | 2,000 % éch. 14/04/2033 | | | 210 | 47 | 0,03 | Total des Instruments à court terme | | | 4 656 | 2,95 | | | | | |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,418 % éch. 25/11/2037 | | | | | | | | 4,625 % éch. 03/04/2049 | | | | | | | | Total des Valeurs mobilières | | | \$ 148 275 | 94,01 | | |
| | | 31 | 28 | 0,02 | Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite | | 4,875 % éch. 18/07/2033 | | € | 400 | 332 | 0,21 | ACTIONS | | | | | | | | | |
| Rochester Financing PLC 5,920 % éch. 18/12/2044 | | | | | | | | 5,000 % éch. 18/01/2053 | | | | | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | | | |
| | £ | 116 | 147 | 0,09 | Obligation internationale du gouvernement turc 9,375 % éch. 19/01/2033 | | 9,375 % éch. 19/01/2033 | | | 500 | 566 | 0,36 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | | | | | | | | |
| Tower Bridge Funding PLC 5,940 % éch. 20/12/2063 | | | | | | | | Obligation internationale du gouvernement ukrainien 4,375 % éch. 27/01/2032 | | | | | | | | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | | | | | | |
| | | 49 | 63 | 0,04 | 7,750 % éch. 01/09/2026 | | 7,750 % éch. 01/09/2026 | | | 300 | 69 | 0,04 | 644 282 | | | 6 420 | 4,07 | | | | | |
| | | | 946 | 0,60 | | | | | | 300 | 84 | 0,05 | PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds | | | | | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | | | | | Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite | | | | | | | | PIMCO China Bond Fund (f) | | | 25 272 | 343 | 0,22 | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust 7,250 % éch. 25/05/2036 | | | | | | | | 8 293 | | | | | | | | 6 763 | | | 4,29 | | | |
| | \$ | 347 | 181 | 0,12 | ACTIONS ORDINAIRES | | | | | | | | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | | | | | | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,690 % éch. 25/09/2037 | | | | | | | | ÉNERGIE | | | | | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds | | | | | | |
| | | 33 | 33 | 0,02 | Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (b)(h) | | | | | | | | 1 000 | | | 100 | 0,06 | | | | | |
| Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,660 % éch. 25/04/2037 | | | | | | | | 361 648 | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement | | | \$ 6 863 | 4,35 | | |
| | | 132 | 85 | 0,05 | SERVICES FINANCIERS | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. 6,445 % éch. 25/12/2035 | | | | | | | | Hypotecaria Su Casita S.A. de C.V. (b) | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 1 100 | 1 004 | 0,64 | 332 624 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| NovaStar Mortgage Funding Trust 5,670 % éch. 25/09/2037 | | | | | | | | MATÉRIAUX | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 100 | 97 | 0,06 | Petra Diamonds Ltd. (b) | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | 1 400 | 0,89 | 331 402 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement argentin 0,750 % éch. 09/07/2030 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 18 | 7 | 0,00 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3,625 % éch. 09/07/2035 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 11 | 4 | 0,00 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Bank Gospodarstwa Krajowego 6,250 % éch. 31/10/2028 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 200 | 211 | 0,13 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|-----------------|----------------------|--------------------|----------------------------|--|---------------------|--|--|------------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 993 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | \$ (1 013) | \$ 993 | \$ 993 | 0,63 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | | | |
| | | | | | | \$ (1 013) | \$ 993 | \$ 993 | 0,63 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Long | 03/2024 | 15 | \$ 32 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 6 | (27) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 151 | 325 | 0,21 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 36 | 84 | 0,05 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 18 | 66 | 0,04 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 7 | (36) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 42 | (506) | (0,32) |
| | | | | \$ (62) | (0,04) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (62) | (0,04) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 % | 20/06/2026 | € 100 | \$ 2 | 0,00 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20/06/2028 | 600 | 44 | 0,03 |
| | | | | \$ 46 | 0,03 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-39 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/06/2028 | \$ 700 | \$ 17 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 3 000 | 62 | 0,04 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 2 300 | 15 | 0,01 |
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | € 1 000 | 51 | 0,03 |
| Indice iTraxx Europe Main 40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 1 700 | 15 | 0,01 |
| | | | | \$ 160 | 0,10 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 % | 21/06/2047 | \$ 1 700 | \$ 217 | 0,14 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 300 | (8) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,131 | 04/01/2027 | BRL 6 500 | 10 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | CNY 2 520 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,205 | 22/04/2027 | ZAR 7 200 | 7 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,210 | 22/04/2027 | 35 600 | 19 | 0,01 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | AUD 3 000 | 78 | 0,05 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,611 | 06/06/2028 | CZK 12 800 | 29 | 0,02 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,930 | 29/06/2028 | PLN 1 700 | (22) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,207 | 19/06/2028 | MXN 6 900 | (8) | (0,01) |
| | | | | | \$ 322 | 0,20 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 528 | 0,33 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽³⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC | America Movil S.A.B. de C.V. | 1,000 % | 20/12/2025 | \$ 1 200 | \$ (30) | \$ 45 | \$ 15 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2028 | 500 | (88) | 55 | (33) | (0,02) |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2026 | 50 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 900 | (42) | 36 | (6) | 0,00 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2024 | 300 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| JPM | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | 400 | (9) | 9 | 0 | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2028 | 400 | (4) | 6 | 2 | 0,00 |
| | | | | | \$ (171) | \$ 151 | \$ (20) | (0,01) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVICES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|---|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GLM | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,053 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | \$ 242 | PHP 13 460 | \$ 0 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |
| JPM | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,054 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 16 | 890 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 0 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | À recevoir ⁽¹⁾ | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/03/2029 | MYR 3 140 | \$ 2 | \$ 1 | \$ 3 | 0,00 |

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 03/2024 | CNH | 1 648 | \$ 229 | \$ 0 | \$ (4) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | CAD | 60 | 44 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | COP | 11 062 049 | 2 750 | 0 | (102) | (0,06) |
| | 01/2024 | NZD | 514 | 313 | 0 | (12) | (0,01) |
| | 01/2024 | PEN | 551 | 148 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN | 185 | 44 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 892 | COP 11 062 049 | 0 | (40) | (0,03) |
| | 01/2024 | | 163 | PLN | 7 | 7 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 334 | CNY | 2 357 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 2 542 | \$ 351 | 0 | (8) | (0,01) |
| | 03/2024 | COP | 11 062 049 | 2 850 | 39 | 0 | 0,02 |
| | 03/2024 | \$ | 78 | INR | 6 501 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | MYR | 9 655 | \$ 2 109 | 0 | (10) | (0,01) |
| | 04/2024 | \$ | 2 105 | MYR 9 710 | 27 | 0 | 0,02 |
| BPS | 01/2024 | COP | 370 327 | \$ 94 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 114 | 124 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 86 861 | 247 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 8 900 | 62 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN | 51 | 14 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN | 1 104 | 260 | 0 | (21) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 184 | CAD 250 | 5 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 97 | COP 370 327 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 198 | HUF 70 029 | 4 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 832 | ¥ 121 700 | 32 | 32 | 0,02 |
| | 01/2024 | | 75 | PLN 329 | 8 | 8 | 0,01 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 02/2024 | TWD 1 683 | \$ 53 | \$ 0 | \$ (3) | \$ (3) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 592 | CNY 4 204 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP 108 213 | \$ 125 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 1 832 | 254 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 2 648 144 | 171 | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN 524 | 141 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 3 271 | 93 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 1 151 | 37 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 93 | COP 370 327 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 124 | IDR 1 955 982 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | 110 | ILS 397 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 270 | INR 22 583 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 93 | PEN 350 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 47 | THB 1 624 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 06/2024 | 109 | KRW 140 192 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | PLN 702 | \$ 161 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 31 | BRL 154 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 76 | TRY 2 270 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 701 | \$ 90 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 04/2024 | \$ 375 | TRY 11 983 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL 660 | \$ 135 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 83 | 62 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | COP 370 327 | 97 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 43 | 46 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 3 444 | 195 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 434 | 103 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 203 | CAD 271 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | 94 | COP 370 327 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 245 | MXN 4 508 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| | 01/2024 | 29 | NOK 306 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 242 | PLN 1 013 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR 7 619 | \$ 401 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| | 03/2024 | ILS 294 | 81 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN 1 022 | 271 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 46 | IDR 713 336 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 281 | PEN 1 046 | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| | 04/2024 | 76 | BRL 374 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 06/2024 | KRW 26 559 | \$ 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ 134 | ZAR 2 553 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 63 | \$ 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF 312 | 356 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| | 01/2024 | DOP 24 930 | 438 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| | 01/2024 | HUF 73 283 | 197 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN 12 662 | 722 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 100 | BRL 506 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 47 | HUF 16 254 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 106 | NOK 1 160 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| | 03/2024 | 94 | PEN 349 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 08/2024 | 43 | COP 185 846 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 151 520 | \$ 431 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 78 | CAD 103 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 373 | BRL 1 831 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP 112 719 | \$ 125 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 1 402 | 194 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD 60 | 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 2 737 | 77 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 81 | INR 6 769 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 08/2024 | 88 | COP 380 578 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 615 | \$ 454 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | 01/2024 | € 6 929 | 7 618 | 0 | (38) | (38) | (0,02) |
| | 01/2024 | HUF 47 613 | 130 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ 26 800 | 187 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 204 | 11 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 242 | AUD 365 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | 193 | £ 153 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 8 643 | \$ 452 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 02/2024 | ¥ 50 000 | 352 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 31 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | PHP 6 728 | 120 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 1 899 | 61 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 109 | INR 9 082 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | HUF 35 854 | \$ 102 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 435 | 105 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 31 | BRL 151 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 77 | CHF 67 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | 74 | € 67 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 59 | HUF 20 720 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 251 | MYR 1 172 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 160 | NZD 252 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 348 | CNY 2 461 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP 27 098 | \$ 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 1 573 | 218 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | THB 1 627 | \$ 47 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 84 | IDR 1 291 714 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 9 171 | \$ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 01/2024 | ¥ 430 000 | 2 916 | 0 | (146) | (146) | (0,09) |
| | 04/2024 | MXN 18 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | NOK 480 | 46 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | MYR 1 909 | 409 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 02/2024 | 3 083 | 648 | 0 | (25) | (25) | (0,02) |
| | 03/2024 | CNH 1 544 | 213 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 3 632 | 105 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 169 | INR 14 136 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2024 | 40 | COP 173 120 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SSB | 03/2024 | IDR 1 665 213 | \$ 107 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 03/2024 | CNH 947 | 131 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 712 | 901 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 30 | MXN 532 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 128 | NOK 1 368 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 5 421 | \$ 284 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | 03/2024 | CZK 7 501 | 337 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | \$ 252 | \$ (667) | \$ (415) | (0,26) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ 301 | CHF 262 | \$ 10 | \$ 0 | \$ 10 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | 2 988 | 2 603 | 107 | 0 | 107 | 0,07 |
| GLM | 01/2024 | CHF 51 | \$ 58 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 266 | CHF 2 862 | 136 | 0 | 136 | 0,08 |
| MYI | 01/2024 | 3 283 | 2 866 | 124 | 0 | 124 | 0,08 |
| | | | | \$ 377 | \$ (2) | \$ 375 | 0,24 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 193 | \$ 210 | \$ 0 | \$ (4) | \$ (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 493 | € 4 118 | 57 | 0 | 57 | 0,04 |
| BRC | 01/2024 | 36 247 | 32 959 | 169 | 0 | 169 | 0,11 |
| CBK | 01/2024 | € 95 | \$ 105 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 19 | € 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 548 | \$ 598 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| MYI | 01/2024 | \$ 39 927 | € 36 326 | 210 | 0 | 210 | 0,13 |
| UAG | 01/2024 | 39 958 | 36 326 | 180 | 0 | 180 | 0,11 |
| | | | | \$ 616 | \$ (12) | \$ 604 | 0,38 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 545 0,35

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| CERTIFICATS DE DÉPÔT | | | |
| Banco Davivienda S.A. | | | |
| 11,679 % éch. 12/05/2025 | COP 1 262 200 | \$ 324 | 0,20 |
| 12,950 % éch. 08/03/2026 | 715 416 | 192 | 0,12 |
| 13,183 % éch. 06/06/2026 | 621 000 | 169 | 0,11 |
| 13,455 % éch. 13/06/2025 | 404 000 | 108 | 0,07 |
| 13,456 % éch. 07/06/2025 | 818 000 | 218 | 0,14 |
| 13,456 % éch. 09/06/2025 | 273 000 | 73 | 0,05 |
| 13,501 % éch. 13/12/2024 | 714 000 | 188 | 0,12 |
| Bancolombia S.A. | | | |
| 5,917 % éch. 27/01/2024 | 1 097 400 | 283 | 0,18 |
| 10,388 % éch. 20/04/2026 | 1 318 900 | 340 | 0,21 |
| 13,320 % éch. 08/06/2025 | 369 000 | 97 | 0,06 |
| 13,456 % éch. 14/06/2025 | 663 000 | 176 | 0,11 |
| 13,637 % éch. 14/12/2024 | 978 000 | 256 | 0,16 |
| 16,137 % éch. 01/09/2024 | 400 000 | 106 | 0,07 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| BBVA Colombia S.A. | | | |
| 13,229 % éch. 10/05/2026 | COP 154 000 | \$ 42 | 0,03 |
| 13,365 % éch. 04/05/2026 | 225 000 | 61 | 0,04 |
| 14,460 % éch. 13/01/2024 | 467 400 | 120 | 0,08 |
| Total des Certificats de dépôt | | \$ 2 753 | 1,75 |
| Total des Investissements | | \$ 159 895 | 101,38 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (2 182) | (1,38) |
| Actifs nets | | \$ 157 713 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,79 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|------------------------|
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » | 10/06/2022 | \$ 39 | \$ 39 | 0,02 |
| Development Bank of Southern Africa 8,600 % éch. 21/10/2024 | 07/10/2021 | 1 498 | 1 216 | 0,77 |
| Invepar Holdings LLC 1,000 % éch. 31/12/2049 | 16/11/2018 | 0 | 0 | 0,00 |
| OAS Restructuring BVI Ltd, 5,000 % éch. 31/03/2035 | 16/11/2018 | 14 | 5 | 0,00 |
| OAS S.A. - Exp. 16/05/2039 | 16/11/2018 | 5 | 0 | 0,00 |
| | | \$ 1 556 | \$ 1 260 | 0,79 |

(i) Un titre d'une juste valeur globale de 177 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 731 \$ (31 décembre 2022 : 1 839 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 296 | \$ 145 730 | \$ 2 249 | \$ 148 275 |
| Fonds d'investissement | 6 763 | 100 | 0 | 6 863 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 993 | 0 | 993 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 4 | 1 007 | 0 | 1 011 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 2 753 | 0 | 2 753 |
| Totaux | \$ 7 063 | \$ 150 583 | \$ 2 249 | \$ 159 895 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 458 | \$ 140 620 | \$ 2 309 | \$ 143 387 |
| Fonds d'investissement | 16 419 | 99 | 0 | 16 518 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 8 386 | 0 | 8 386 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 191 | 3 630 | 0 | 3 821 |
| Totaux | \$ 17 068 | \$ 152 735 | \$ 2 309 | \$ 172 112 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 4,050 % | 28/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | \$ (165) | \$ (166) | (0,11) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (166) | (0,11) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|--------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes |
| AZD | \$ (4) | \$ 0 | \$ (4) | \$ (141) | \$ 0 | \$ (141) |
| BOA | (103) | 0 | (103) | 92 | (40) | 52 |
| BPS | 71 | 0 | 71 | (36) | 0 | (36) |
| BRC | 139 | (340) | (201) | (2) | 0 | (2) |
| CBK | 107 | 0 | 107 | 1 221 | (1 150) | 71 |
| DUB | 5 | 0 | 5 | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 107 | 0 | 107 | 1 | 0 | 1 |
| GST | 4 | 0 | 4 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (10) | 0 | (10) | 14 | 0 | 14 |
| MBC | (87) | 0 | (87) | 648 | (550) | 98 |
| MYC | 2 | 0 | 2 | (5) | 0 | (5) |
| MYI | 330 | (540) | (210) | 76 | 0 | 76 |
| RBC | (146) | 0 | (146) | S/O | S/O | S/O |
| RYL | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| SCX | (37) | 0 | (37) | 981 | (940) | 41 |
| SSB | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (3) | 0 | (3) | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 172 | (390) | (218) | (36) | 0 | (36) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 77,71 | 67,07 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 16,30 | 17,79 |
| Fonds d'investissement | 4,35 | 9,77 |
| Contrats de mise en pension | 0,63 | 4,96 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,04) | 0,10 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,33 | 0,50 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,35 | 1,66 |
| Certificats de dépôt | 1,75 | S/O |
| Contrats de prise en pension | (0,11) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 1,79 | 1,15 |
| Obligations et billets privés | 75,63 | 70,02 |
| Obligations et billets convertibles | 0,26 | S/O |
| Agences du gouvernement américain | 2,18 | 0,76 |
| Obligations du Trésor américain | 4,19 | 3,90 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 0,60 | 0,77 |
| Titres adossés à des actifs | 0,89 | 0,84 |
| Émissions souveraines | 5,26 | 3,53 |
| Actions ordinaires | 0,26 | 0,52 |
| Bons de souscription | 0,00 | 0,00 |
| Instruments à court terme | 2,95 | 3,37 |
| Fonds d'investissement | 4,35 | 9,77 |
| Contrats de mise en pension | 0,63 | 4,96 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,04) | 0,10 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03 | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,10 | 0,20 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,20 | 0,31 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01) | (0,02) |
| Swaps sur devises croisées | 0,00 | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,00 | S/O |
| Swaps de volatilité | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,26) | (0,24) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,62 | 1,92 |
| Certificats de dépôt | 1,75 | S/O |
| Autres actifs et passifs à court terme | (1,38) | (1,85) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|---------|----------------------------------|------------------------------|
| INSTRUMENTS A COURT TERME | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | PIMCO Select Funds plc - | | | | Fonds PIMCO US Dollar | | | |
| 10,900 % éch. | | | | (0,226) % éch. | ¥ 183 000 | \$ 1 298 | 0,46 | Short-Term Floating NAV | | | |
| 04/01/2024 (a)(b) HUF | 2 804 000 | \$ 8 099 | 2,87 | 15/01/2024 (a)(b) | | | | 20 899 | \$ 208 | 0,08 | |
| BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | | (0,216) % éch. | 2 866 000 | 20 331 | 7,19 | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| (0,252) % éch. | | | | 22/01/2024 (a)(b) | 278 000 | 1 972 | 0,70 | PIMCO ETFs plc - Fonds | | | |
| 26/02/2024 (a)(b) | ¥ 1 158 000 | 8 216 | 2,90 | (0,197) % éch. | | | | PIMCO US Dollar Short | | | |
| (0,238) % éch. | | | | 22/01/2024 (a)(b) | | 36 314 | 12,84 | Maturity UCITS ETF (e) | | | |
| 15/01/2024 (a)(b) | 322 000 | 2 284 | 0,81 | Total des Instruments à court terme | | 44 413 | 15,71 | 6 300 | 628 | 0,22 | |
| (0,231) % éch. | | | | Total des Valeurs mobilières | \$ 264 943 | 93,69 | | Total des Fonds d'investissement | | | |
| 26/02/2024 (a)(b) | 312 000 | 2 213 | 0,78 | | | | | \$ 836 | 0,30 | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|-------------------|--|--|---------------------|
| SSB | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 6 274 | Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 31/10/2025 | \$ (6 400) | \$ 6 274 | \$ 6 275 | 2,22 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (6 400) | \$ 6 274 | \$ 6 275 | 2,22 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NEGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 7 | \$ 32 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 272 | 628 | 0,22 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 148 | (523) | (0,18) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 1 | (5) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 30 | (388) | (0,14) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (256) | (0,09) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,900 % | 25/08/2028 | £ 11 000 | \$ 699 | 0,25 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2029 | INR 1 520 420 | (46) | (0,02) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,232 | 05/10/2025 | ¥ 15 220 000 | (194) | (0,07) |
| À payer ⁽¹⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,250 | 20/03/2026 | THB 866 415 | (7) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 20/03/2029 | 358 480 | 6 | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 20/03/2029 | 204 760 | 78 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 16/06/2031 | \$ 2 500 | 313 | 0,11 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 17/06/2025 | 400 | (30) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/12/2050 | 1 500 | 632 | 0,22 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/06/2051 | 4 500 | 1 038 | 0,37 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 21/06/2024 | 7 100 | (49) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 18/12/2024 | 270 | 12 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 18/12/2029 | 4 100 | 402 | 0,14 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,562 | 14/02/2024 | 22 300 | 839 | 0,30 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/12/2031 | 2 700 | 423 | 0,15 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 8 900 | (1 140) | (0,40) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,319 | 30/05/2033 | 12 400 | (249) | (0,09) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 17 800 | (221) | (0,08) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 21 200 | 766 | 0,27 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 1 300 | (49) | (0,02) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 200 | (3) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 200 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 100 | 10 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 400 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 300 | (11) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 100 | 5 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 300 | (13) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 300 | 17 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155 | 02/10/2033 | 400 | 23 | 0,01 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 % | 03/10/2033 | \$ 1 200 | \$ 70 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 100 | 6 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 200 | 13 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 | 23/10/2033 | 100 | 6 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 300 | (18) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393 | 25/10/2033 | 100 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 200 | 17 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 400 | 34 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 5,585 | 02/01/2025 | BRL 10 000 | (278) | (0,10) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 6,225 | 02/01/2025 | 4 600 | (95) | (0,03) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 6,750 | 02/01/2025 | 10 500 | 154 | 0,05 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 6,962 | 04/01/2027 | 8 300 | (157) | (0,06) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 8,589 | 04/01/2027 | 11 900 | 178 | 0,06 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 8,621 | 02/01/2025 | 6 000 | (26) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,772 | 04/01/2027 | 56 200 | 19 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,145 | 04/01/2027 | 2 500 | (14) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,231 | 04/01/2027 | 9 400 | (46) | (0,02) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,472 | 04/01/2027 | 28 200 | (87) | (0,03) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,559 | 02/01/2025 | 45 000 | 21 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,602 | 04/01/2027 | 45 800 | 59 | 0,02 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,665 | 02/01/2024 | 5 800 | (46) | (0,02) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,755 | 02/01/2024 | 22 000 | (165) | (0,06) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,800 | 02/01/2024 | 51 900 | 378 | 0,13 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,831 | 02/01/2025 | 125 300 | (16) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,833 | 02/01/2024 | 31 800 | (230) | (0,08) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,995 | 02/01/2024 | 15 300 | (100) | (0,04) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,065 | 02/01/2024 | 10 600 | (65) | (0,02) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,083 | 04/01/2027 | 22 200 | 14 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,134 | 04/01/2027 | 27 200 | (122) | (0,04) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,148 | 02/01/2024 | 2 600 | (15) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,199 | 04/01/2027 | 24 800 | (42) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,439 | 04/01/2027 | 15 500 | 95 | 0,03 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,449 | 04/01/2027 | 15 500 | 95 | 0,03 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,456 | 02/01/2026 | 38 300 | 164 | 0,06 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,839 | 02/01/2025 | 65 900 | (73) | (0,03) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,920 | 02/01/2024 | 99 100 | 389 | 0,14 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,920 | 02/01/2025 | 88 400 | 9 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,946 | 04/01/2027 | 37 800 | (323) | (0,11) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,026 | 02/01/2025 | 22 100 | 7 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,131 | 04/01/2027 | 25 200 | (82) | (0,03) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,132 | 04/01/2027 | 21 700 | 203 | 0,07 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,231 | 02/01/2025 | 15 500 | 17 | 0,01 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,260 | 01/04/2024 | 466 000 | (26) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,290 | 02/01/2024 | 54 800 | (201) | (0,07) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,350 | 01/07/2024 | 52 300 | (18) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,490 | 01/07/2024 | 56 100 | (36) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,569 | 02/01/2029 | 16 000 | (232) | (0,08) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,595 | 01/07/2024 | 46 000 | 44 | 0,02 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,721 | 02/01/2029 | 19 000 | 293 | 0,10 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,784 | 02/01/2029 | 20 500 | 323 | 0,11 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,981 | 04/01/2027 | 27 000 | 359 | 0,13 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,080 | 01/07/2024 | 100 300 | 188 | 0,07 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,257 | 02/01/2029 | 39 300 | (730) | (0,26) |
| À payer ⁽¹⁾ | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | CNY 62 560 | 12 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 2,690 | 24/07/2024 | COP 7 257 000 | 123 | 0,04 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 2,740 | 24/07/2024 | 7 084 900 | (120) | (0,04) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 3,100 | 26/11/2025 | 2 651 000 | 73 | 0,03 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 4,060 | 26/11/2025 | 14 071 000 | 322 | 0,11 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 4,110 | 23/03/2026 | 4 493 200 | (90) | (0,03) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 4,651 | 26/11/2025 | 2 624 800 | (53) | (0,02) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 6,130 | 26/10/2026 | 25 320 800 | 378 | 0,13 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 6,885 | 31/01/2025 | 24 609 000 | 267 | 0,09 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,080 | 02/02/2027 | 1 622 900 | 13 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,090 | 28/04/2028 | 1 750 200 | 12 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,130 | 31/01/2027 | 8 865 000 | 67 | 0,02 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,130 | 28/04/2028 | 618 500 | 4 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,140 | 28/04/2028 | 1 855 800 | 12 | 0,00 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,320 | 31/03/2027 | 2 908 000 | 10 | 0,00 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,560 | 30/03/2027 | 4 424 200 | 23 | 0,01 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,686 | 30/03/2027 | 26 334 600 | 158 | 0,06 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,830 | 31/03/2028 | 4 898 000 | (54) | (0,02) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,940 | 24/03/2030 | 11 638 000 | (210) | (0,07) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,140 | 28/04/2028 | 3 977 000 | 51 | 0,02 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,520 | 15/03/2028 | 20 872 100 | 351 | 0,12 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,800 | 17/01/2028 | 9 809 000 | 170 | 0,06 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,265 | 12/04/2025 | 41 439 000 | (25) | (0,01) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,640 | 21/10/2025 | 11 114 000 | (127) | (0,04) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,930 | 10/11/2025 | 5 929 100 | 80 | 0,03 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,000 | 26/11/2025 | 427 000 | (6) | 0,00 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 12,060 | 09/11/2025 | 4 198 000 | 59 | 0,02 |
| À payer ⁽¹⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,750 | 20/03/2034 | KRW 5 813 150 | 56 | 0,02 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,757 | 14/04/2026 | ZAR 96 300 | (248) | (0,09) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,650 | 05/10/2033 | AUD 12 200 | 446 | 0,16 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notional | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 % | 20/12/2028 | AUD 32 700 | \$ 867 | 0,31 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | 18 700 | 198 | 0,07 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 1,947 | 23/11/2027 | CLP 999 000 | 121 | 0,04 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 1,950 | 05/05/2026 | 1 239 600 | (113) | (0,04) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 1,965 | 24/11/2027 | 851 000 | 104 | 0,04 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 2,020 | 30/04/2026 | 1 300 000 | (117) | (0,04) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 2,183 | 04/12/2027 | 2 661 000 | (290) | (0,10) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 2,640 | 01/03/2026 | 795 000 | 65 | 0,02 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,530 | 06/07/2026 | 1 995 000 | 146 | 0,05 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,000 | 06/07/2028 | 1 019 000 | 63 | 0,02 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,050 | 01/04/2033 | 2 200 000 | 6 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,180 | 01/10/2028 | 790 000 | (12) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,240 | 01/09/2030 | 1 286 000 | (23) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,260 | 01/03/2026 | 620 000 | 6 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,360 | 27/03/2028 | 1 914 900 | (31) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,370 | 01/10/2028 | 3 136 000 | (68) | (0,02) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,470 | 01/09/2030 | 460 000 | (14) | (0,01) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,548 | 10/04/2028 | 833 000 | 23 | 0,01 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,570 | 01/10/2028 | 245 000 | (10) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,600 | 12/12/2027 | 1 803 000 | (65) | (0,02) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,635 | 12/12/2027 | 3 695 000 | (133) | (0,05) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,700 | 17/05/2028 | 1 602 100 | (68) | (0,02) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,734 | 18/05/2028 | 9 093 000 | (377) | (0,13) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,855 | 05/10/2033 | 5 448 000 | (351) | (0,12) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,020 | 02/03/2029 | 190 000 | 13 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,070 | 28/02/2028 | 3 391 700 | (150) | (0,05) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,170 | 30/10/2033 | 3 885 900 | (422) | (0,15) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,194 | 10/03/2028 | 1 681 200 | 91 | 0,03 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,223 | 13/03/2028 | 680 300 | 37 | 0,01 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,255 | 13/03/2028 | 478 200 | 31 | 0,01 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,270 | 02/03/2027 | 415 700 | 18 | 0,01 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,330 | 09/03/2028 | 526 800 | 35 | 0,01 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,360 | 25/05/2027 | 24 600 | 1 | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,386 | 24/05/2027 | 1 861 000 | 103 | 0,04 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,440 | 07/03/2028 | 1 344 000 | 85 | 0,03 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,500 | 12/12/2025 | 2 564 000 | (71) | (0,03) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,535 | 09/01/2026 | 9 540 000 | 112 | 0,04 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,567 | 12/12/2025 | 1 464 000 | (44) | (0,02) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,570 | 22/12/2025 | 1 277 000 | (42) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,590 | 22/12/2025 | 3 565 000 | (111) | (0,04) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,590 | 21/03/2027 | 4 540 300 | 162 | 0,06 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,805 | 06/03/2027 | 1 852 000 | 107 | 0,04 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,000 | 27/09/2032 | 1 785 800 | 304 | 0,11 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,265 | 07/03/2026 | 262 400 | 13 | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,270 | 07/03/2026 | 2 463 000 | 107 | 0,04 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,370 | 06/03/2026 | 1 686 000 | 80 | 0,03 |
| À payer ⁽¹⁾ | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,025 | 29/07/2030 | CZK 35 800 | (143) | (0,05) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,224 | 28/01/2031 | 44 500 | (318) | (0,11) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,575 | 26/03/2026 | 28 100 | (76) | (0,03) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,725 | 22/07/2026 | 23 800 | (84) | (0,03) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,815 | 28/01/2031 | 34 200 | 181 | 0,06 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 2,000 | 19/06/2024 | 26 100 | (28) | (0,01) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 3,490 | 18/01/2032 | 10 600 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 3,680 | 03/03/2027 | 78 400 | (56) | (0,02) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,164 | 14/03/2027 | 73 600 | (76) | (0,03) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,220 | 14/03/2027 | 73 500 | (83) | (0,03) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,300 | 18/03/2027 | 143 400 | 208 | 0,07 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,310 | 15/03/2027 | 19 100 | (24) | (0,01) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,320 | 15/03/2027 | 7 200 | (9) | 0,00 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,560 | 14/07/2032 | 111 300 | (228) | (0,08) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,611 | 06/06/2028 | 118 100 | 267 | 0,09 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,640 | 18/05/2028 | 64 400 | 176 | 0,06 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,740 | 28/02/2033 | 91 700 | 460 | 0,16 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,740 | 28/02/2033 | 91 700 | (239) | (0,08) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,040 | 17/04/2028 | 27 900 | 96 | 0,03 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,100 | 18/04/2028 | 11 800 | 42 | 0,01 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,110 | 22/03/2026 | 72 500 | (129) | (0,05) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,125 | 22/03/2026 | 50 000 | (90) | (0,03) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,480 | 15/03/2026 | 216 500 | 483 | 0,17 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,606 | 28/06/2027 | 54 800 | 217 | 0,08 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 15/12/2040 | € 300 | 129 | 0,05 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 3 400 | (387) | (0,14) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 400 | (6) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 200 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 200 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 300 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 500 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,970 | 15/12/2033 | 1 500 | (62) | (0,02) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 600 | (26) | (0,01) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 12 800 | 421 | 0,15 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 100 | (6) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 1 500 | (61) | (0,02) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 06/11/2033 | 500 | (33) | (0,01) |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 % | 22/11/2028 | € 200 | \$ (8) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 08/11/2028 | 600 | (22) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 14 200 | 1 148 | 0,41 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 1 200 | 55 | 0,02 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 1,500 | 19/06/2024 | HUF 1 427 600 | (174) | (0,06) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 1,760 | 21/01/2030 | 380 000 | 270 | 0,10 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 1,958 | 19/03/2026 | 398 600 | (126) | (0,04) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 5,500 | 04/03/2027 | 2 382 600 | 47 | 0,02 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 6,280 | 18/03/2027 | 2 363 300 | 208 | 0,07 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 13,600 | 12/12/2024 | 1 418 700 | (192) | (0,07) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 1,110 | 12/01/2031 | 9 800 | 544 | 0,19 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 1,165 | 28/01/2031 | 4 400 | (87) | (0,03) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | WIBOR PLN à 6 mois | 1,215 | 29/07/2030 | 10 300 | 314 | 0,11 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 1,855 | 28/01/2031 | 6 000 | (251) | (0,09) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 1,933 | 17/01/2025 | 11 800 | (198) | (0,07) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 2,635 | 28/10/2026 | 32 900 | (352) | (0,12) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 3,035 | 09/12/2026 | 42 000 | 475 | 0,17 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,075 | 07/03/2027 | 28 700 | (22) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,710 | 25/05/2027 | 12 000 | (62) | (0,02) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,735 | 09/10/2028 | 12 100 | (40) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,740 | 25/10/2033 | 7 100 | (38) | (0,01) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 4,830 | 18/03/2027 | 17 300 | 172 | 0,06 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 4,895 | 17/03/2027 | 7 200 | 59 | 0,02 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 4,920 | 17/03/2027 | 15 000 | 128 | 0,05 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,300 | 25/04/2028 | 11 900 | (218) | (0,08) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 6,670 | 28/06/2027 | 6 200 | 158 | 0,06 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,725 | 27/06/2027 | 20 700 | (540) | (0,19) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 6,843 | 28/06/2027 | 1 500 | 41 | 0,01 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 7,310 | 30/06/2027 | 11 000 | (347) | (0,12) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,080 | 16/06/2025 | 16 400 | (73) | (0,03) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,700 | 12/09/2030 | 35 400 | (301) | (0,11) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 5,770 | 09/10/2030 | 150 700 | 1 261 | 0,45 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,850 | 19/08/2030 | 12 100 | (96) | (0,03) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,875 | 16/08/2030 | 16 800 | (133) | (0,05) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,880 | 16/08/2030 | 8 700 | (69) | (0,02) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,920 | 16/08/2030 | 9 100 | (71) | (0,02) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,240 | 10/07/2026 | 113 600 | (426) | (0,15) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,480 | 28/05/2040 | 16 700 | (64) | (0,02) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 6,495 | 17/07/2026 | 140 500 | 563 | 0,20 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 6,505 | 17/07/2026 | 102 100 | 408 | 0,14 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,580 | 01/01/2025 | 29 700 | (78) | (0,03) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,830 | 27/12/2029 | 19 900 | (94) | (0,03) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,570 | 19/11/2026 | 300 | (1) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,675 | 04/06/2029 | 65 100 | (144) | (0,05) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,465 | 16/08/2027 | 167 300 | 132 | 0,05 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,480 | 24/03/2027 | 121 900 | (149) | (0,05) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,560 | 18/05/2028 | 14 500 | 5 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,585 | 18/05/2028 | 14 700 | 4 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,600 | 18/05/2028 | 7 400 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,610 | 18/05/2028 | 7 600 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,645 | 18/05/2028 | 7 600 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,656 | 18/05/2028 | 17 300 | 2 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,700 | 05/11/2027 | 8 700 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,740 | 07/03/2028 | 192 900 | (72) | (0,03) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,743 | 05/11/2027 | 37 900 | (6) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,760 | 05/11/2027 | 25 400 | (3) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,773 | 05/11/2027 | 20 000 | (2) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,845 | 04/12/2028 | 214 700 | (34) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,045 | 04/11/2027 | 17 200 | 7 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,053 | 04/11/2027 | 18 900 | 8 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,117 | 04/11/2027 | 47 100 | 27 | 0,01 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,165 | 05/11/2026 | 25 600 | (2) | 0,00 |
| | | | | | \$ 7 323 | 2,59 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 7 323 | 2,59 |

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM | Option d'achat - USD contre JPY hors cote | ¥ 167,000 | 05/11/2024 | 1 708 | \$ 87 | \$ 30 | 0,01 |
| JPM | Option de vente - EUR contre PLN hors cote | PLN 4,400 | 22/08/2024 | 585 | 147 | 341 | 0,12 |
| | | | | | \$ 234 | \$ 371 | 0,13 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - USD contre BRL hors cote | BRL 4,923 | 26/06/2024 | 2 800 | \$ (115) | \$ (107) | (0,04) |
| | Option de vente - USD contre BRL hors cote | 4,923 | 26/06/2024 | 2 800 | (116) | (99) | (0,04) |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 17,449 | 26/06/2024 | 2 800 | (97) | (94) | (0,03) |
| CBK | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 2 800 | (97) | (97) | (0,03) |
| | Option d'achat - USD contre BRL hors cote | BRL 4,968 | 20/06/2024 | 8 800 | (365) | (296) | (0,11) |
| | Option de vente - USD contre BRL hors cote | 4,968 | 20/06/2024 | 8 800 | (365) | (354) | (0,13) |
| DUB | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | MXN 17,450 | 01/07/2024 | 2 600 | (91) | (90) | (0,03) |
| | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,450 | 01/07/2024 | 2 600 | (91) | (90) | (0,03) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | TRY 40,385 | 28/10/2024 | 610 | (61) | (41) | (0,01) |
| GLM | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,385 | 28/10/2024 | 610 | (61) | (66) | (0,02) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 40,250 | 30/10/2024 | 616 | (62) | (42) | (0,02) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,250 | 30/10/2024 | 616 | (62) | (65) | (0,02) |
| MYI | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 39,800 | 31/10/2024 | 306 | (30) | (22) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 39,800 | 31/10/2024 | 306 | (30) | (30) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 40,930 | 07/11/2024 | 304 | (29) | (20) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,930 | 07/11/2024 | 304 | (29) | (35) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 41,150 | 07/11/2024 | 304 | (29) | (20) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 41,150 | 07/11/2024 | 304 | (29) | (36) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 41,160 | 11/11/2024 | 304 | (29) | (21) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 41,160 | 11/11/2024 | 304 | (29) | (36) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 19,500 | 07/03/2024 | 4 072 | (46) | (6) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 3 900 | (135) | (132) | (0,05) |
| | | 17,449 | 26/06/2024 | 3 900 | (135) | (135) | (0,05) |
| | | | | | \$ (2 133) | \$ (1 934) | (0,69) |

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 200 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 500 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,590 | 05/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,700 | 18/01/2024 | 500 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,300 | 16/01/2024 | 1 000 | (4) | (3) | (0,01) |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,750 | 16/01/2024 | 1 000 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,440 | 08/01/2024 | 800 | (2) | (3) | 0,00 |
| BRC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,860 | 08/01/2024 | 800 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,600 | 12/01/2024 | 100 | (1) | (2) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,050 | 12/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,490 | 12/01/2024 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 3,030 | 04/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,330 | 15/01/2024 | 1 200 | (5) | (3) | 0,00 |
| | | | | 2,740 | 15/01/2024 | 1 200 | (5) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (36) | \$ (30) | (0,01) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS | Obligation internationale du gouvernement égyptien | 1,000 % | 20/12/2024 | \$ 2 600 | \$ (221) | \$ 44 | \$ (177) | (0,06) |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 1 200 | (84) | 78 | (6) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 | 20/06/2024 | 400 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| JPM | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | 600 | (13) | 13 | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ (316) | \$ 135 | \$ (181) | (0,06) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|--|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Taux variable égal à LIBOR INR à 3 mois plus 0,069 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | INR 180 139 | \$ 2 154 | \$ 6 | \$ 28 | \$ 34 | 0,01 |
| GLM | Taux variable égal à LIBOR INR à 3 mois plus 0,069 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 709 400 | 8 482 | 26 | 109 | 135 | 0,05 |
| JPM | Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,282 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 07/06/2027 | \$ 100 | ARS 4 488 | 0 | 99 | 99 | 0,04 |
| SCX | Taux variable égal à LIBOR INR à 3 mois plus 0,069 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | INR 180 040 | \$ 2 153 | 6 | 28 | 34 | 0,01 |
| | | | 20/03/2029 | 444 906 | 5 319 | 16 | 69 | 85 | 0,03 |
| | | | | | | \$ 54 | \$ 333 | \$ 387 | 0,14 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | À recevoir ⁽¹⁾ | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/03/2029 | MYR 3 310 | \$ 2 | \$ 1 | \$ 3 | 0,00 |
| JPM | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,020 | 06/06/2024 | CLP 770 000 | 0 | (21) | (21) | (0,01) |
| | | | | | | \$ 2 | \$ (20) | \$ (18) | (0,01) |

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 840 | AUD 1 268 | \$ 26 | \$ 0 | \$ 26 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH 2 561 | \$ 355 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | COP 13 509 292 | 3 532 | 49 | 0 | 49 | 0,02 |
| | 01/2024 | DOP 34 076 | 595 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 106 | 134 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 845 089 | 2 286 | 0 | (150) | (150) | (0,05) |
| | 01/2024 | NZD 1 972 | 1 202 | 0 | (47) | (47) | (0,02) |
| | 01/2024 | PEN 18 603 | 5 013 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 2 032 | 477 | 0 | (40) | (40) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 445 | AUD 673 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 01/2024 | 3 359 | COP 13 509 292 | 124 | 0 | 124 | 0,04 |
| | 01/2024 | 20 164 | HUF 7 181 003 | 530 | 0 | 530 | 0,19 |
| | 01/2024 | 2 356 | ¥ 347 638 | 112 | 0 | 112 | 0,04 |
| | 01/2024 | 161 | NOK 1 707 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | 618 | PLN 2 582 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| | 02/2024 | CNY 16 572 | \$ 2 291 | 0 | (52) | (52) | (0,02) |
| | 02/2024 | \$ 1 801 | CNY 12 726 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | 131 | KES 20 868 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | ZMW 8 652 | \$ 377 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH 3 604 | 498 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 03/2024 | DOP 2 637 | 46 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 3 481 | COP 13 509 292 | 0 | (47) | (47) | (0,02) |
| | 03/2024 | 2 275 | IDR 35 930 668 | 55 | 0 | 55 | 0,02 |
| | 03/2024 | 464 | PEN 1 764 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 03/2024 | 25 | PHP 1 377 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | MYR 29 355 | \$ 6 414 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 04/2024 | \$ 6 400 | MYR 29 521 | 82 | 0 | 82 | 0,03 |
| | 06/2024 | 355 | BRL 1 748 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 06/2024 | 105 | KES 17 655 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 06/2024 | 503 | MXN 8 777 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 2 605 | \$ 2 847 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 404 | 512 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 14 820 | 42 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 53 900 | 374 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN 1 970 | 529 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 617 | AUD 935 | \$ 22 | \$ 0 | \$ 22 | 0,01 |
| | 01/2024 | 714 | € 652 | 7 | (1) | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 10 012 | ¥ 1 412 100 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 215 | PLN 13 498 | 217 | 0 | 217 | 0,08 |
| | 01/2024 | ZAR 38 465 | \$ 2 075 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| | 02/2024 | TWD 19 674 | 619 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ 3 197 | CNY 22 696 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 2 494 | \$ 347 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 35 779 097 | 2 291 | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 5 521 | COP 22 160 797 | 112 | 0 | 112 | 0,04 |
| | 03/2024 | 3 420 | IDR 54 446 468 | 111 | 0 | 111 | 0,04 |
| | 03/2024 | 290 | TWD 9 114 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | ¥ 505 000 | \$ 3 453 | 0 | (135) | (135) | (0,05) |
| | 01/2024 | PLN 104 976 | 24 008 | 0 | (2 681) | (2 681) | (0,95) |
| | 01/2024 | TRY 71 673 | 2 355 | 0 | (38) | (38) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 3 722 | MYR 17 324 | 58 | 0 | 58 | 0,02 |
| | 01/2024 | 607 | TRY 18 103 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 1 470 000 | \$ 9 914 | 0 | (598) | (598) | (0,21) |
| | 02/2024 | \$ 5 317 | TRY 166 141 | 68 | (3) | 65 | 0,02 |
| | 03/2024 | 1 | THB 43 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 541 | TRY 79 778 | 12 | (4) | 8 | 0,00 |
| | 04/2024 | 35 | 1 131 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL 7 177 | \$ 1 474 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | CLP 1 909 412 | 2 178 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 24 171 | 26 379 | 0 | (328) | (328) | (0,12) |
| | 01/2024 | £ 7 647 | 9 613 | 0 | (135) | (135) | (0,05) |
| | 01/2024 | HUF 48 170 | 131 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 391 200 | 2 750 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN 4 567 | 262 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 2 045 | 507 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 753 | AUD 1 112 | 7 | (1) | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 157 | CLP 1 912 648 | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| | 01/2024 | 286 | £ 226 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 8 627 | HUF 2 977 029 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| | 01/2024 | 2 799 | ¥ 395 200 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 27 649 | MXN 490 330 | 1 176 | 0 | 1 176 | 0,42 |
| | 01/2024 | 39 | NOK 413 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 079 | PLN 4 497 | 65 | 0 | 65 | 0,02 |
| | 01/2024 | 225 | ZMW 5 566 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP 6 270 | \$ 167 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 6 223 | BRL 31 921 | 338 | 0 | 338 | 0,12 |
| | 02/2024 | 409 | EGP 14 313 | 0 | (39) | (39) | (0,01) |
| | 03/2024 | CLP 1 920 521 | \$ 2 157 | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| | 03/2024 | ILS 450 | 124 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN 24 202 | 6 429 | 0 | (92) | (92) | (0,03) |
| | 03/2024 | \$ 751 | EGP 27 760 | 0 | (118) | (118) | (0,04) |
| | 03/2024 | 3 072 | PEN 11 616 | 58 | 0 | 58 | 0,02 |
| | 03/2024 | ZMW 14 042 | \$ 569 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| | 04/2024 | \$ 1 474 | BRL 7 249 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 04/2024 | 441 | EGP 16 704 | 0 | (62) | (62) | (0,02) |
| | 04/2024 | 404 | KES 66 341 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 18 257 | \$ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ 1 137 | BRL 5 648 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 06/2024 | 328 | KES 55 179 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2024 | 464 | MXN 8 097 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | PLN 732 | \$ 183 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 111 | PLN 433 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 182 | ZMW 4 528 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP 15 155 | \$ 437 | 26 | 0 | 26 | 0,01 |
| | 02/2024 | \$ 2 218 | EGP 77 705 | 0 | (210) | (210) | (0,07) |
| | 02/2024 | 388 | ZMW 9 118 | 0 | (34) | (34) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH 1 715 | \$ 238 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD 10 065 | 7 604 | 0 | (54) | (54) | (0,02) |
| | 04/2024 | \$ 242 | KES 39 485 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2024 | € 3 876 | PLN 17 898 | 206 | 0 | 206 | 0,07 |
| | 10/2024 | \$ 207 | TRY 8 376 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 11/2024 | ¥ 186 742 | \$ 1 323 | 0 | (61) | (61) | (0,02) |
| FAR | 01/2024 | BRL 1 448 | 297 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 71 409 818 | 4 539 | 0 | (92) | (92) | (0,03) |
| | 04/2024 | \$ 297 | BRL 1 463 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CHF 1 561 | \$ 1 782 | 0 | (74) | (74) | (0,03) |
| | 01/2024 | DOP 260 663 | 4 576 | 107 | 0 | 107 | 0,04 |
| | 01/2024 | HUF 1 656 121 | 4 446 | 0 | (326) | (326) | (0,12) |
| | 01/2024 | MXN 573 733 | 32 707 | 0 | (1 021) | (1 021) | (0,36) |
| | 01/2024 | \$ 1 046 | HUF 388 096 | 73 | 0 | 73 | 0,03 |
| | 01/2024 | 5 700 | MXN 97 986 | 60 | 0 | 60 | 0,02 |
| | 01/2024 | 5 894 | TRY 179 131 | 96 | 0 | 96 | 0,03 |
| | 02/2024 | BRL 54 | \$ 11 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | DOP 67 652 | 1 177 | 17 | 0 | 17 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH 1 115 | 155 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | DOP 124 789 | 2 181 | 46 | 0 | 46 | 0,02 |
| | 03/2024 | \$ 24 | TRY 764 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | DOP 25 763 | \$ 448 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 10/2024 | \$ 209 | TRY 8 412 | \$ 8 | \$ 0 | \$ 8 | 0,00 |
| | 11/2024 | 1 323 | ¥ 186 955 | 63 | 0 | 63 | 0,02 |
| | 11/2024 | 422 | TRY 17 219 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| IND | 06/2024 | 815 | TWD 20 969 | 0 | (113) | (113) | (0,04) |
| JPM | 01/2024 | BRL 26 892 | \$ 5 513 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN 1 192 | 69 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 10 484 | 2 396 | 0 | (269) | (269) | (0,09) |
| | 01/2024 | \$ 296 | BRL 1 443 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 50 | EGP 1 641 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 646 | PLN 14 403 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 02/2024 | EGP 47 299 | \$ 1 248 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| | 02/2024 | \$ 5 308 | BRL 26 033 | 43 | 0 | 43 | 0,02 |
| | 02/2024 | 7 191 | INR 600 715 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 02/2024 | 5 995 | TRY 184 301 | 33 | (1) | 32 | 0,01 |
| | 03/2024 | TWD 50 584 | \$ 1 627 | 0 | (49) | (49) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 5 513 | BRL 27 078 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| | 04/2024 | KES 133 703 | \$ 870 | 47 | 0 | 47 | 0,02 |
| | 04/2024 | \$ 446 | KES 72 905 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MBC | 08/2024 | PLN 17 851 | € 3 876 | 0 | (194) | (194) | (0,07) |
| | 01/2024 | CAD 846 | \$ 625 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| | 01/2024 | € 16 086 | 17 686 | 0 | (87) | (87) | (0,03) |
| | 01/2024 | HUF 3 160 975 | 8 616 | 0 | (493) | (493) | (0,17) |
| | 01/2024 | ¥ 2 020 000 | 14 132 | 0 | (206) | (206) | (0,07) |
| | 01/2024 | \$ 394 | AUD 595 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | 64 | EGP 2 100 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 318 | € 292 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 | PLN 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 03/2024 | PHP 235 809 | \$ 4 214 | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| | 01/2024 | EGP 18 824 | 507 | 0 | (44) | (44) | (0,02) |
| | 01/2024 | € 53 | 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR 27 193 | 5 827 | 0 | (107) | (107) | (0,04) |
| | 01/2024 | NGN 116 850 | 190 | 74 | 0 | 74 | 0,03 |
| | 01/2024 | PLN 746 | 189 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 306 | EGP 10 285 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | 16 | € 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 896 | ¥ 132 056 | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| | 01/2024 | 2 212 | PLN 9 188 | 124 | 0 | 124 | 0,04 |
| | 01/2024 | 680 | ZAR 12 498 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP 38 449 | \$ 923 | 2 | (76) | (74) | (0,03) |
| | 02/2024 | \$ 1 877 | CNY 13 289 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | 431 | EGP 14 958 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH 2 444 | \$ 339 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 03/2024 | MXN 5 212 | 295 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 11 550 | IDR 177 777 105 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 06/2024 | KRW 2 500 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 06/2024 | \$ 697 | MXN 12 162 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 530 | BRL 26 892 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 270 | MXN 4 630 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 04/2024 | MXN 835 | \$ 47 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 458 | BRL 7 181 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| | 01/2024 | 0 | EGP 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 7 139 | MYR 33 344 | 138 | 0 | 138 | 0,05 |
| | 01/2024 | 142 | NGN 116 724 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| | 01/2024 | 441 | ZMW 10 814 | 0 | (21) | (21) | (0,01) |
| | 02/2024 | MYR 1 517 | \$ 332 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 114 | KES 18 183 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 328 | MYR 1 521 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 2 399 | \$ 331 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 2 849 | THB 98 480 | 55 | 0 | 55 | 0,02 |
| | 03/2024 | 220 | TWD 6 940 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SOG | 06/2024 | KES 68 980 | \$ 449 | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| | 01/2024 | \$ 147 | EGP 4 785 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 02/2024 | 5 003 | RON 22 945 | 89 | 0 | 89 | 0,03 |
| | 03/2024 | 1 288 | CZK 29 037 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 03/2024 | 106 | TWD 3 347 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | CLP 5 057 673 | \$ 5 721 | 0 | (66) | (66) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 4 547 | IDR 71 097 847 | 63 | 0 | 63 | 0,02 |
| | 03/2024 | 3 722 | PHP 207 275 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| TOR | 01/2024 | HUF 427 806 | \$ 1 124 | 0 | (109) | (109) | (0,04) |
| | 01/2024 | \$ 1 480 | ¥ 217 167 | 61 | 0 | 61 | 0,02 |
| | 03/2024 | CNH 1 160 | \$ 161 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | € 1 289 | 1 414 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 2 193 | 2 776 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 960 337 | 2 558 | 0 | (210) | (210) | (0,07) |
| | 01/2024 | ¥ 3 144 000 | 21 326 | 0 | (1 035) | (1 035) | (0,37) |
| | 01/2024 | \$ 6 927 | HUF 2 571 155 | 482 | 0 | 482 | 0,17 |
| | 01/2024 | 890 | NOK 9 498 | 45 | 0 | 45 | 0,02 |
| | 01/2024 | ZAR 154 191 | \$ 8 078 | 0 | (343) | (343) | (0,12) |
| | 03/2024 | CZK 30 600 | 1 375 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | | | | \$ 5 750 | \$ (10 450) | \$ (4 700) | (1,66) |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 173 | \$ 1 288 | \$ 0 | \$ (9) | \$ (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | INR 138 619 | \$ 1 661 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 854 | € 2 569 | 2 | (18) | (16) | (0,01) |
| BRC | 01/2024 | 509 | THB 17 888 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 02/2024 | TRY 50 496 | \$ 1 611 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| CBK | 01/2024 | € 19 | 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 148 036 | 429 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 321 277 | 2 275 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 20 510 | 1 210 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 99 | BRL 487 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 965 | € 4 595 | 112 | 0 | 112 | 0,04 |
| | 01/2024 | 390 | £ 310 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | HUF 455 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 351 | RON 1 604 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 12 | ZAR 235 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL 489 | \$ 99 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 1 204 | MXN 20 510 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| FAR | 01/2024 | BRL 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 0 | BRL 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | MYR 2 016 | \$ 434 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 444 | CNY 17 257 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | 935 | CZK 20 693 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | 433 | MYR 2 016 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 897 | PLN 11 581 | 48 | 0 | 48 | 0,02 |
| | 02/2024 | TRY 33 598 | \$ 1 089 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ 435 | MYR 2 016 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | BRL 487 | \$ 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY 774 | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | \$ 26 618 | € 24 211 | 134 | 0 | 134 | 0,05 |
| | 01/2024 | 1 192 | MXN 20 510 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| | 01/2024 | 5 | TRY 161 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 13 757 | € 12 516 | 72 | 0 | 72 | 0,02 |
| | 01/2024 | 43 | PLN 171 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 19 | CNY 138 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 01/2024 | IDR 5 170 544 | \$ 333 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | HUF 913 322 | 2 661 | 22 | 0 | 22 | 0,01 |
| | 01/2024 | \$ 0 | CZK 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 238 | £ 188 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 140 | PLN 560 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 797 | ZAR 14 794 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | | | | \$ 466 | \$ (104) | \$ 362 | 0,13 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (partiellement couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 19 | £ 15 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 6 | THB 223 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | ¥ 4 029 | \$ 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 255 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY 47 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 | £ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | HUF 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | ZAR 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 15 | MXN 255 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | MYR 25 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 31 | CNY 220 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 12 | CZK 262 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 | MYR 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 38 | PLN 152 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | TRY 478 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 5 | MYR 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | TRY 557 | \$ 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 | TRY 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 15 | MXN 255 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 11 | \$ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 37 | € 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 52 | £ 41 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | HUF 1 823 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | INR 1 743 | 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 0 | CNY 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 135 | £ 107 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SOG | 01/2024 | IDR 50 560 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | \$ 14 | € 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| UAG | 01/2024 | HUF 11 167 | \$ 33 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 0 | CZK 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 331 | £ 262 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 | PLN 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 10 | ZAR 184 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 5 | \$ 0 | \$ 5 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (5 738) (2,03)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| CERTIFICATS DE DÉPÔT | | | |
| Banco Davivienda S.A. | | | |
| 10,942 % éch. 28/04/2026 | COP 100 000 | \$ 26 | 0,01 |
| 11,679 % éch. 12/05/2025 | 1 420 000 | 365 | 0,13 |
| 12,950 % éch. 08/03/2026 | 1 800 246 | 483 | 0,17 |
| 13,183 % éch. 06/06/2026 | 1 772 000 | 482 | 0,17 |
| 13,455 % éch. 13/06/2025 | 1 172 000 | 312 | 0,11 |
| 13,456 % éch. 07/06/2025 | 1 189 000 | 316 | 0,11 |
| 13,456 % éch. 09/06/2025 | 397 000 | 106 | 0,04 |
| 13,501 % éch. 13/12/2024 | 1 000 000 | 264 | 0,09 |
| 15,389 % éch. 21/02/2024 | 289 500 | 76 | 0,03 |
| Bancolombia S.A. | | | |
| 5,917 % éch. 27/01/2024 | 1 311 000 | 338 | 0,12 |
| 10,388 % éch. 20/04/2026 | 2 361 700 | 609 | 0,22 |
| 13,320 % éch. 08/06/2025 | 540 000 | 142 | 0,05 |
| 13,456 % éch. 14/06/2025 | 2 146 000 | 570 | 0,20 |
| 13,637 % éch. 14/12/2024 | 1 432 000 | 375 | 0,13 |
| 16,137 % éch. 01/09/2024 | 561 000 | 148 | 0,05 |
| BBVA Colombia S.A. | | | |
| 13,093 % éch. 28/04/2026 | 520 000 | 142 | 0,05 |
| 13,229 % éch. 10/05/2026 | 224 000 | 61 | 0,02 |
| 13,365 % éch. 04/05/2026 | 327 000 | 88 | 0,03 |
| 14,460 % éch. 13/01/2024 | 543 100 | 140 | 0,05 |
| Total des Certificats de dépôt | | \$ 5 043 | 1,78 |
| Total des Investissements | | \$ 278 425 | 98,46 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ 4 365 | 1,54 |
| Actifs nets | | \$ 282 790 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Un titre d'une juste valeur globale de 5 239 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 7 361 \$ (31 décembre 2022 : 4 974 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 5 780 \$ (31 décembre 2022 : 5 521 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 250 859 | \$ 14 084 | \$ 264 943 |
| Fonds d'investissement | 208 | 628 | 0 | 836 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 6 274 | 0 | 6 274 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 32 | 1 297 | 0 | 1 329 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 5 043 | 0 | 5 043 |
| Totaux | \$ 240 | \$ 264 101 | \$ 14 084 | \$ 278 425 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 180 287 | \$ 1 313 | \$ 181 600 |
| Fonds d'investissement | 14 173 | 624 | 0 | 14 797 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 706 | 0 | 706 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 126 | 3 194 | (7) | 3 313 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 0 | 137 | 137 |
| Totaux | \$ 14 299 | \$ 184 811 | \$ 1 443 | \$ 200 553 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BOS | 5,540 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ (5 269) | \$ (5 271) | (1,86) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (5 271) | (1,86) |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 20 | \$ 0 | \$ 20 | \$ (17) | \$ 0 | \$ (17) |
| BOA | 323 | (610) | (287) | (2 672) | 2 460 | (212) |
| BPS | 158 | 0 | 158 | (2 204) | 1 480 | (724) |
| BRC | (3 336) | 3 320 | (16) | (334) | 510 | 176 |
| CBK | 115 | (350) | (235) | (169) | 10 | (159) |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (239) | 0 | (239) |
| DUB | (238) | 0 | (238) | 653 | (650) | 3 |
| FAR | (92) | 0 | (92) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | (974) | 1 080 | 106 | (338) | 440 | 102 |
| GST | 2 | 0 | 2 | 203 | (260) | (57) |
| HUS | S/O | S/O | S/O | (8) | 0 | (8) |
| IND | (113) | 80 | (33) | (94) | 340 | 246 |
| JPM | 20 | 0 | 20 | 224 | 0 | 224 |
| MBC | (678) | 570 | (108) | 847 | (804) | 43 |
| MYC | (5) | 0 | (5) | 84 | 0 | 84 |
| MYI | (255) | 20 | (235) | (104) | 281 | 177 |
| RBC | 7 | 0 | 7 | (4) | 0 | (4) |
| SCX | 292 | 0 | 292 | 922 | (790) | 132 |
| SOG | 94 | 0 | 94 | 86 | 0 | 86 |
| SSB | 17 | 0 | 17 | 630 | (630) | 0 |
| TOR | (51) | 0 | (51) | 151 | 0 | 151 |
| UAG | (1 044) | 710 | (334) | 251 | (420) | (169) |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 86,38 | 54,96 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 7,31 | 32,75 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 0,83 |
| Fonds d'investissement | 0,30 | 7,21 |
| Contrats de mise en pension | 2,22 | 0,34 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,09) | 0,34 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 2,59 | 2,31 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (2,03) | (1,04) |
| Certificats de dépôt | 1,78 | 0,07 |
| Contrats de prise en pension | (1,86) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Argentine | S/O | 0,49 |
| Angola | 1,37 | S/O |
| Bahamas | S/O | 0,37 |
| Biélorussie | S/O | 0,08 |
| Brésil | 2,68 | 2,65 |
| Cameroun | 0,23 | S/O |
| Îles Caïmans | 1,15 | 0,70 |
| Chili | 3,95 | S/O |
| Chine | 0,02 | 0,02 |
| Colombie | 0,52 | S/O |
| Congo | 0,17 | 0,27 |
| Costa Rica | 0,31 | S/O |
| République tchèque | 1,43 | S/O |
| Danemark | 0,00 | 2,08 |
| République dominicaine | 3,91 | 1,52 |
| Équateur | 1,38 | S/O |
| Égypte | 1,36 | S/O |
| Ghana | S/O | 0,48 |
| Guatemala | 0,33 | S/O |
| Hong Kong | 0,47 | S/O |
| Hongrie | 0,83 | S/O |
| Inde | 0,17 | S/O |
| Irlande | 2,15 | 3,14 |
| Israël | 2,57 | 2,82 |
| Côte d'Ivoire | 0,26 | 0,45 |
| Jamaïque | 0,23 | S/O |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | S/O | 1,29 |
| Kenya | 0,41 | S/O |
| Luxembourg | 0,43 | 1,19 |
| Mexique | 6,82 | 4,32 |
| Pays-Bas | 0,42 | 2,16 |
| Pakistan | 0,47 | S/O |
| Panama | 0,16 | S/O |
| Pérou | 3,24 | 3,18 |
| Pologne | 8,42 | 1,16 |
| Roumanie | 1,80 | S/O |
| Russie | S/O | 0,05 |
| Serbie | 0,04 | 0,05 |
| Afrique du Sud | 6,45 | 5,04 |
| Corée du Sud | 0,20 | S/O |
| Supranationales | 0,19 | S/O |
| Tanzanie | 0,78 | S/O |
| Tunisie | 0,93 | 0,09 |
| Turquie | 1,24 | 0,91 |
| Ukraine | 0,75 | S/O |
| Émirats arabes unis | 0,19 | 0,26 |
| Royaume-Uni | 0,61 | 1,36 |
| États-Unis | 18,29 | 20,18 |
| Ouzbékistan | 0,47 | 0,62 |
| Îles Vierges britanniques | S/O | 1,24 |
| Zambie | 0,18 | S/O |
| Instruments à court terme | 15,71 | 30,37 |
| Fonds d'investissement | 0,30 | 7,21 |
| Contrats de mise en pension | 2,22 | 0,34 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,09) | 0,34 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,08 |
| Swaps de taux d'intérêt | 2,59 | 2,23 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Options de change | 0,13 | 0,29 |
| Options vendues | | |
| Options de change | (0,69) | S/O |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,01) | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,06) | (0,42) |
| Swaps sur devises croisées | 0,14 | 0,04 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,01) | 0,12 |
| Swaps de volatilité | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (1,66) | (1,81) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,13 | 0,75 |
| Certificats de dépôt | 1,78 | 0,07 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 1,54 | 2,23 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | |
| AZERBAÏDJAN | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC 7,230 % éch. 17/03/2026 | \$ 200 | \$ 199 | 1,00 |
| BRÉSIL | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banco do Brasil S.A. 8,500 % éch. 29/07/2026 | MXN 2 000 | 111 | 0,55 |
| Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. 0,000 % éch. 29/01/2024 (c)(f) | \$ 23 | 1 | 0,01 |
| Oi S.A. 0,000 % éch. 25/02/2035 | BRL 50 | 5 | 0,02 |
| Vale S.A. 0,000 % (f) | 1 490 | 109 | 0,55 |
| Total Brésil | | 226 | 1,13 |
| ÎLES CAÏMANS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Interoceanica Finance Ltd. 0,000 % éch. 30/11/2025 (c) | \$ 10 | 9 | 0,05 |
| CHILI | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos 3,400 % éch. 01/10/2039 | CLP 36 789 | 4 | 0,24 |
| 5,000 % éch. 01/10/2028 | 250 000 | 283 | 1,42 |
| 5,300 % éch. 01/11/2037 | 5 000 | 6 | 0,03 |
| 5,800 % éch. 01/10/2034 | 115 000 | 136 | 0,68 |
| 6,000 % éch. 01/04/2033 | 125 000 | 150 | 0,75 |
| Total Chili | | 622 | 3,12 |
| CHINE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Flourish Century 6,600 % éch. 04/02/2022 ^ (i) | \$ 200 | 18 | 0,09 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement chinois 2,750 % éch. 17/02/2032 | CNY 30 | 4 | 0,02 |
| 3,020 % éch. 27/05/2031 | 600 | 88 | 0,44 |
| | | 92 | 0,46 |
| Total Chine | | 110 | 0,55 |
| COLOMBIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Empresas Publicas de Medellín ESP 7,625 % éch. 10/09/2024 | COP 540 000 | 134 | 0,67 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement colombien 1,000 % éch. 18/09/2030 | 323 700 | 76 | 0,38 |
| 1,000 % éch. 26/03/2031 | 676 600 | 151 | 0,76 |
| 1,000 % éch. 30/06/2032 | 153 000 | 33 | 0,17 |
| Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter 7,875 % éch. 12/08/2024 | 12 000 | 3 | 0,01 |
| | | 263 | 1,32 |
| Total Colombie | | 397 | 1,99 |
| RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque 2,000 % éch. 13/10/2033 | CZK 400 | 15 | 0,07 |
| 2,500 % éch. 25/08/2028 | 1 900 | 81 | 0,41 |
| Total République tchèque | | 96 | 0,48 |
| DANEMARK | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Jyske Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053 | DKK 0 | 0 | 0,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| DANEMARK | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 0 | \$ 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 0 | 0,00 |
| Total Danemark | | 0 | 0,00 |
| RÉPUBLIQUE DOMINICAINE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Billets de la Banque centrale de République dominicaine 12,000 % éch. 03/10/2025 | DOP 3 800 | 67 | 0,34 |
| 13,000 % éch. 30/01/2026 | 3 200 | 58 | 0,29 |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | | | |
| 11,250 % éch. 15/09/2035 | 8 000 | 149 | 0,75 |
| 13,625 % éch. 03/02/2033 | 8 000 | 168 | 0,84 |
| 13,625 % éch. 10/02/2034 | 200 | 4 | 0,02 |
| Total République dominicaine | | 446 | 2,24 |
| ÉQUATEUR | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement d'Équateur | | | |
| 3,500 % éch. 31/07/2035 | \$ 39 | 14 | 0,07 |
| 6,000 % éch. 31/07/2030 | 110 | 52 | 0,26 |
| Total Équateur | | 66 | 0,33 |
| HONGRIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois | | | |
| 4,750 % éch. 24/11/2032 | HUF 6 200 | 16 | 0,08 |
| 6,750 % éch. 22/10/2028 | 4 200 | 13 | 0,07 |
| Total Hongrie | | 29 | 0,15 |
| IRLANDE | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Black Diamond CLO DAC 4,853 % éch. 20/01/2032 | € 60 | 6 | 0,33 |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,752 % éch. 15/11/2031 | 100 | 109 | 0,55 |
| Harvest CLO DAC 4,566 % éch. 26/06/2030 | 66 | 72 | 0,36 |
| | | 248 | 1,24 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC 9,350 % éch. 06/08/2022 ^ | RUB 33 000 | 11 | 0,06 |
| Total Irlande | | 259 | 1,30 |
| ISRAËL | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 200 | 226 | 1,13 |
| JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Corsair International Ltd. 8,802 % éch. 28/01/2027 | 100 | 110 | 0,55 |
| LUXEMBOURG | | | |
| ACTIONS | | | |
| ACTIONS ORDINAIRES | | | |
| DrillCo Holding Lux S.A. (b) | 311 | 8 | 0,04 |
| DrillCo Holding Lux S.A. (b)(i) | 787 | 19 | 0,10 |
| Total Actions ordinaires | | 27 | 0,14 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| FORESEA Holding S.A. 7,500 % éch. 15/06/2030 | € 14 | \$ 13 | 0,06 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (h) | 200 | 12 | 0,06 |
| | | 25 | 0,12 |
| Total Luxembourg | | 52 | 0,26 |
| MALAISIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien | | | |
| 4,696 % éch. 15/10/2042 | MYR 147 | 35 | 0,18 |
| 4,762 % éch. 07/04/2037 | 66 | 15 | 0,07 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien | | | |
| 3,990 % éch. 15/10/2025 | 182 | 40 | 0,20 |
| Total Malaisie | | 90 | 0,45 |
| MEXIQUE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. 8,790 % éch. 09/12/2014 ^ | MXN 5 000 | 0 | 0,00 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | |
| 2,750 % éch. 27/11/2031 (e) | 1 089 | 57 | 0,28 |
| 3,000 % éch. 03/12/2026 (e) | 3 991 | 219 | 1,10 |
| 5,750 % éch. 05/03/2026 | 2 000 | 109 | 0,55 |
| 7,500 % éch. 03/06/2027 | 2 100 | 117 | 0,59 |
| | | 502 | 2,52 |
| Total Mexique | | 502 | 2,52 |
| PÉROU | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % éch. 17/09/2024 | PEN 1 230 | 322 | 1,61 |
| Credicorp Capital Sociedad Tituladora S.A. 10,100 % éch. 15/12/2043 | 700 | 191 | 0,96 |
| | | 513 | 2,57 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Fondo MIVIVIENDA S.A. 7,000 % éch. 14/02/2024 | 130 | 35 | 0,18 |
| Total Pérou | | 548 | 2,75 |
| POLOGNE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement polonais | | | |
| 1,250 % éch. 25/10/2030 | PLN 50 | 10 | 0,05 |
| 1,750 % éch. 25/04/2032 | 100 | 20 | 0,10 |
| 2,500 % éch. 25/07/2027 | 770 | 181 | 0,91 |
| 6,000 % éch. 25/10/2033 | 200 | 54 | 0,27 |
| 7,500 % éch. 25/07/2028 | 600 | 168 | 0,84 |
| Total Pologne | | 433 | 2,17 |
| ROUMANIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement roumain | | | |
| 4,250 % éch. 28/04/2036 | RON 100 | 18 | 0,09 |
| 6,375 % éch. 18/09/2033 | € 100 | 117 | 0,59 |
| Total Roumanie | | 135 | 0,68 |
| AFRIQUE DU SUD | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Banque de développement d'Afrique du Sud 8,600 % éch. 21/10/2024 (i) | ZAR 3 200 | 174 | 0,87 |
| Eskom Holdings SOC Ltd. 7,850 % éch. 02/04/2026 | 5 000 | 266 | 1,33 |
| | | 440 | 2,20 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | |
| 2,000 % éch. 31/01/2025 (e) | 2 683 | 144 | 0,72 |
| 8,000 % éch. 31/01/2030 | 3 500 | 176 | 0,88 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 13 500 | 773 | 3,88 |
| | | 1 093 | 5,48 |
| Total Afrique du Sud | | 1 533 | 7,68 |
| CORÉE DU SUD | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Korea Southern Power Co. Ltd. 5,375 % éch. 21/09/2026 | \$ 200 | 202 | 1,01 |
| THAÏLANDE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,300 % éch. 17/06/2038 | THB 10 | 0 | 0,00 |
| 3,350 % éch. 17/06/2033 | 10 | 1 | 0,01 |
| 3,450 % éch. 17/06/2043 | 5 | 0 | 0,00 |
| Total Thaïlande | | 1 | 0,01 |
| ROYAUME-UNI | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Harbour Energy PLC 6,120 % éch. 28/01/2054 | £ 100 | 127 | 0,64 |
| ÉTATS-UNIS | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,788 % éch. 25/01/2035 | \$ 34 | 35 | 0,17 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust 5,530 % éch. 25/07/2045 | 7 | 4 | 0,02 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,950 % éch. 25/02/2037 | 42 | 40 | 0,20 |
| 6,595 % éch. 25/11/2035 | 54 | 53 | 0,27 |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 5,590 % éch. 25/11/2036 | 2 | 1 | 0,01 |
| Fieldstone Mortgage Investment Trust 5,850 % éch. 25/05/2036 | 71 | 50 | 0,25 |
| GSAMP Trust 5,560 % éch. 25/01/2037 | 45 | 26 | 0,13 |
| Home Equity Asset Trust 6,070 % éch. 25/11/2032 | 4 | 3 | 0,01 |
| HSI Asset Loan Obligation Trust 4,646 % éch. 25/12/2036 | 2 | 1 | 0,01 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,530 % éch. 25/05/2037 | 3 | 2 | 0,01 |
| 6,235 % éch. 25/01/2035 | 23 | 22 | 0,11 |
| 6,265 % éch. 25/03/2034 | 43 | 43 | 0,22 |
| Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust 6,820 % éch. 25/02/2033 | 13 | 13 | 0,06 |
| New Century Home Equity Loan Trust 5,830 % éch. 25/05/2036 | 6 | 6 | 0,03 |
| Saxon Asset Securities Trust 5,780 % éch. 25/09/2037 | 10 | 10 | 0,05 |
| Soundview Home Loan Trust 5,550 % éch. 25/06/2037 | 4 | 3 | 0,01 |
| 5,640 % éch. 25/07/2037 | 55 | 47 | 0,24 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,690 % éch. 25/10/2037 | 131 | 82 | 0,41 |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust 5,710 % éch. 25/05/2037 | 49 | 42 | 0,21 |
| Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust 4,290 % éch. 25/10/2036 | 4 | 1 | 0,01 |
| | | 484 | 2,43 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Banc of America Mortgage Trust 5,267 % éch. 25/07/2034 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,877 % éch. 25/05/2047 | 5 | 5 | 0,02 |
| Bear Stearns ALT-A Trust 3,884 % éch. 25/04/2037 | 172 | 125 | 0,63 |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 3,993 % éch. 26/12/2046 | 12 | 9 | 0,04 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust 4,523 % éch. 25/09/2037 | 78 | 69 | 0,35 |
| 5,540 % éch. 25/01/2037 | 2 | 2 | 0,01 |
| First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 5,464 % éch. 25/08/2035 | 3 | 2 | 0,01 |
| GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates 5,725 % éch. 25/10/2033 | 1 | 1 | 0,01 |
| IndyMac Mortgage Loan Trust 3,506 % éch. 25/11/2037 | 67 | 56 | 0,28 |
| 4,699 % éch. 25/12/2034 | 3 | 2 | 0,01 |
| 6,110 % éch. 25/07/2045 | 27 | 21 | 0,10 |
| Lehman XS Trust 5,850 % éch. 25/09/2046 | 103 | 86 | 0,43 |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust 5,791 % éch. 25/10/2037 | 43 | 36 | 0,18 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 6,000 % éch. 25/10/2036 | 2 | 2 | 0,01 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,858 % éch. 25/02/2037 | 7 | 6 | 0,03 |
| | | 422 | 2,11 |
| Total États-Unis | | 906 | 4,54 |
| URUGUAY | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen 3,700 % éch. 26/06/2037 (e) | UYU 697 | 18 | 0,09 |
| 3,875 % éch. 02/07/2040 (e) | 126 | 4 | 0,02 |
| Total Uruguay | | 22 | 0,11 |
| ZAMBIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement zambien 11,000 % éch. 17/06/2024 | ZMW 500 | 20 | 0,10 |
| 12,000 % éch. 04/07/2025 | 500 | 18 | 0,09 |
| Total Zambie | | 38 | 0,19 |
| INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | |
| 10,900 % éch. 04/01/2024 (c)(d) | HUF 692 000 | 1 999 | 10,02 |
| BONS DU TRÉSOR ISRAÏÉLIEN | | | |
| 4,701 % éch. 03/01/2024 (c)(d) | ILS 3 800 | 1 055 | 5,29 |
| BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | |
| (0,270) % éch. 13/02/2024 (c)(d) | ¥ 200 000 | 1 419 | 7,11 |
| (0,217) % éch. 19/02/2024 (c)(d) | 150 000 | 1 064 | 5,33 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| (0,210) % éch. 19/02/2024 (c)(d) | ¥ 40 000\$ | 283 | 1,42 |
| (0,200) % éch. 04/03/2024 (c)(d) | 10 000 | 71 | 0,35 |
| (0,180) % éch. 11/03/2024 (c)(d) | 30 000 | 213 | 1,07 |
| (0,170) % éch. 13/02/2024 (c)(d) | 10 000 | 71 | 0,36 |
| (0,144) % éch. 10/01/2024 (c)(d) | 10 000 | 71 | 0,36 |
| (0,024) % éch. 22/01/2024 (c)(d) | 10 000 | 71 | 0,36 |
| | | 3 263 | 16,36 |
| BONS DU TRÉSOR MALAISIE | | | |
| 3,228 % éch. 06/02/2024 (c)(d) MYR | 570 | 124 | 0,62 |
| 3,289 % éch. 06/02/2024 (c)(d) | 410 | 89 | 0,45 |
| 3,407 % éch. 09/04/2024 (c)(d) | 3 100 | 669 | 3,35 |
| | | 882 | 4,42 |
| BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| 5,364 % éch. 16/04/2024 (c)(d) | \$ 200 | 197 | 0,99 |
| 5,383 % éch. 23/01/2024 (c)(d) | 200 | 199 | 1,00 |
| 5,386 % éch. 29/02/2024 (c)(d) | 500 | 496 | 2,49 |
| 5,399 % éch. 15/02/2024 (a)(c)(d) | 1 100 | 1 093 | 5,46 |
| 5,405 % éch. 08/02/2024 (c)(d) | 500 | 497 | 2,49 |
| 5,479 % éch. 18/01/2024 (c)(d) | 500 | 499 | 2,50 |
| 5,506 % éch. 30/01/2024 (c)(d) | 200 | 199 | 1,00 |
| | | 3 180 | 15,93 |
| Total des Instruments à court terme | | 10 379 | 52,02 |
| Total des Valeurs mobilières | \$ | 17 763 | 89,05 |
| ACTIONS | | | |
| FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (g) | 15 103 | 205 | 1,03 |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g) | 10 616 | 106 | 0,53 |
| | | 311 | 1,56 |
| FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g) | 15 300 | 1 526 | 7,65 |
| Total des Fonds d'investissement | \$ | 1 837 | 9,21 |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net | |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-----------------------------|-------------------------|--|--|---------------------|------|
| SSB | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 158 | Billets du Trésor américain | 0,250 % éch. 31/10/2025 | \$ (161) | \$ 158 | \$ 158 | 0,79 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | \$ (161) | \$ 158 | \$ 158 | 0,79 |

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 | \$ 5 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 2 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 5 | 0,03 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 5 | 0,03 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Index CDX.IG-41 Index à 5 ans | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 4 800 | \$ (16) | (0,08) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|------------------------|
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 % | 20/03/2029 | £ 600 | \$ 12 | 0,06 |
| À payer | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,600 | 20/12/2033 | INR 5 930 | 1 | 0,01 |
| À recevoir | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,621 | 20/12/2028 | 8 869 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,625 | 20/12/2025 | 23 134 | (1) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,232 | 05/10/2025 | ¥ 150 000 | (2) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,350 | 21/03/2026 | 155 000 | (3) | (0,01) |
| À recevoir | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 3,322 | 20/12/2028 | SGD 84 | (1) | 0,00 |
| À payer | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,770 | 20/12/2028 | THB 1 579 | 0 | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 20/03/2034 | 217 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | \$ 1 450 | 42 | 0,21 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 65 | (8) | (0,04) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 90 | (7) | (0,03) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 100 | (1) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735 | 07/08/2033 | 100 | 2 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 700 | 9 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 200 | (8) | (0,04) |
| À payer ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 400 | 2 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 100 | (3) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 100 | 10 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 100 | 6 | 0,03 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,830 | 02/01/2026 | BRL 2 200 | 1 | 0,01 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 9,946 | 04/01/2027 | 400 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,164 | 02/01/2026 | 300 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,491 | 02/01/2025 | 800 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,529 | 02/01/2026 | 1 000 | (2) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,691 | 02/01/2026 | 1 600 | 5 | 0,03 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,768 | 04/01/2027 | 500 | (2) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,792 | 04/01/2027 | 3 900 | 17 | 0,08 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,872 | 04/01/2027 | 800 | (4) | (0,02) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,280 | 02/01/2026 | 90 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,439 | 02/01/2029 | 700 | 3 | 0,02 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,773 | 02/01/2025 | 200 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,040 | 01/04/2024 | 4 600 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,260 | 01/04/2024 | 4 000 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,350 | 01/07/2024 | 1 300 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,490 | 01/07/2024 | 1 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,569 | 02/01/2029 | 200 | (3) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,595 | 01/07/2024 | 1 200 | 1 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,080 | 01/07/2024 | 2 600 | 5 | 0,02 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,241 | 02/01/2025 | 200 | (1) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | CNY 2 886 | (1) | (0,01) |
| À payer | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,405 | 20/12/2028 | 918 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 4,040 | 13/01/2031 | COP 1 002 000 | 50 | 0,25 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 4,200 | 18/09/2030 | 514 560 | (10) | (0,05) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,500 | 15/02/2025 | 112 850 | 1 | 0,01 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,590 | 17/07/2033 | 475 000 | 2 | 0,01 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,680 | 17/07/2028 | 799 000 | (1) | (0,01) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,705 | 26/03/2031 | 548 600 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,800 | 30/06/2032 | 112 500 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,960 | 01/09/2028 | 540 900 | (5) | (0,02) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,020 | 04/12/2030 | 235 500 | (2) | (0,01) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,190 | 13/06/2029 | 494 700 | 4 | 0,02 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notional | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,820 % | 05/06/2028 | COP 185 700 | \$ (1) | 0,00 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,890 | 12/05/2029 | 269 000 | 4 | 0,02 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,940 | 24/03/2030 | 291 130 | (5) | (0,03) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,050 | 02/05/2033 | 35 360 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,055 | 26/08/2026 | 200 000 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,370 | 17/03/2030 | 73 900 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,393 | 21/03/2030 | 172 000 | (4) | (0,02) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,423 | 17/03/2030 | 218 700 | (5) | (0,03) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,470 | 01/07/2025 | 285 000 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,792 | 06/11/2028 | ILS 270 | (1) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,500 | 20/03/2029 | KRW 249 007 | (2) | (0,01) |
| À payer | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,580 | 20/12/2033 | 63 344 | 2 | 0,01 |
| À recevoir | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,700 | 20/12/2025 | 257 908 | (1) | (0,01) |
| À payer | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,820 | 20/12/2028 | 295 105 | 4 | 0,02 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,067 | 21/12/2026 | ZAR 3 100 | 6 | 0,03 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,635 | 04/02/2027 | 3 290 | (3) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,205 | 22/04/2027 | 1 200 | 1 | 0,01 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,210 | 22/04/2027 | 900 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,565 | 22/03/2026 | 2 900 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,185 | 31/07/2026 | 3 500 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,195 | 21/12/2026 | 5 500 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,210 | 21/12/2026 | 9 000 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 13/07/2025 | 2 200 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 10/11/2028 | 900 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,440 | 02/11/2028 | 300 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,500 | 17/10/2027 | 8 760 | 10 | 0,05 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,650 | 31/01/2030 | 200 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,695 | 31/01/2030 | 1 100 | (1) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,700 | 31/01/2030 | 1 000 | (1) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,735 | 31/01/2030 | 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,820 | 31/01/2030 | 860 | (1) | (0,01) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,290 | 26/05/2028 | 3 100 | 6 | 0,03 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,435 | 13/07/2033 | 600 | 1 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,455 | 31/01/2030 | 1 800 | 6 | 0,03 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,390 | 30/12/2028 | AUD 260 | 4 | 0,02 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2028 | 840 | 21 | 0,10 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,215 | 14/01/2030 | CLP 86 260 | 9 | 0,05 |
| À recevoir ⁽³⁾ | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,640 | 01/10/2028 | 245 000 | 1 | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,995 | 17/07/2033 | 15 400 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,240 | 01/09/2030 | 37 210 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,250 | 20/03/2028 | 95 100 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,350 | 01/09/2030 | 37 500 | (1) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,400 | 01/04/2033 | 22 100 | (1) | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,400 | 16/11/2033 | 17 400 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,470 | 01/09/2030 | 50 000 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,500 | 13/11/2028 | 15 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,550 | 05/06/2028 | 81 300 | 5 | 0,02 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,631 | 23/08/2028 | 56 700 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,690 | 01/09/2030 | 2 400 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,780 | 03/10/2028 | 19 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,790 | 06/10/2033 | 18 000 | (1) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,855 | 05/10/2033 | 46 000 | (4) | (0,02) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,870 | 11/10/2033 | 18 200 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,920 | 02/10/2028 | 36 000 | (2) | (0,01) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,940 | 20/10/2033 | 8 000 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,990 | 20/10/2033 | 76 260 | (7) | (0,04) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,115 | 17/07/2025 | 66 200 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,146 | 30/10/2032 | 125 400 | (13) | (0,07) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,235 | 26/10/2033 | 37 300 | (4) | (0,02) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,370 | 29/06/2029 | 39 000 | 4 | 0,02 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,380 | 03/06/2027 | 116 000 | 8 | 0,04 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,611 | 06/06/2028 | CZK 4 390 | (11) | (0,06) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 100 | (11) | (0,06) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 400 | (8) | (0,04) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,100 | 20/09/2030 | 290 | 13 | 0,06 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 100 | (3) | (0,02) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 600 | 9 | 0,05 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,329 | 27/10/2033 | 100 | 7 | 0,04 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 7,330 | 06/11/2028 | HUF 33 500 | 4 | 0,02 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 7,610 | 03/11/2028 | 24 000 | 5 | 0,02 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 7,840 | 07/02/2033 | 6 600 | (3) | (0,01) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 8,740 | 28/04/2028 | 15 800 | (5) | (0,03) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 13,600 | 12/12/2024 | 5 100 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 0,980 | 09/06/2030 | PLN 300 | 14 | 0,07 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 2,950 | 13/12/2026 | 1 500 | 18 | 0,09 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,075 | 07/03/2027 | 800 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,320 | 09/03/2027 | 150 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,560 | 06/11/2028 | 340 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,735 | 09/10/2028 | 300 | (1) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,910 | 25/07/2027 | 340 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,220 | 20/03/2033 | 200 | (4) | (0,02) |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,310 % | 21/03/2033 | PLN 70 | \$ (2) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,340 | 28/03/2027 | 100 | (1) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,380 | 20/09/2025 | 500 | 1 | 0,00 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,430 | 16/03/2028 | 570 | 6 | 0,03 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,520 | 20/03/2026 | 500 | 5 | 0,03 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,620 | 21/03/2026 | 300 | 3 | 0,02 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,830 | 19/08/2024 | 3 000 | (5) | (0,02) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,714 | 12/12/2028 | MXN 2 000 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,728 | 22/05/2028 | 2 350 | 1 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,295 | 30/10/2028 | 50 | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ 149 | 0,75 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 133 | 0,67 |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| GLM | Option d'achat - USD contre JPY hors cote | ¥ 167,000 | 05/11/2024 | 72 | \$ 4 | \$ 1 | 0,01 |
| JPM | Option de vente - EUR contre PLN hors cote | PLN 4,400 | 22/08/2024 | 28 | 7 | 16 | 0,08 |
| MYI | Option de vente - GBP contre USD hors cote | \$ 1,160 | 12/06/2024 | 760 | 3 | 2 | 0,01 |
| | | | | | \$ 14 | \$ 19 | 0,10 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|--|---|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - USD contre BRL hors cote | BRL 4,923 | 26/06/2024 | 100 | \$ (4) | \$ (4) | (0,02) |
| | Option de vente - USD contre BRL hors cote | 4,923 | 26/06/2024 | 100 | (4) | (4) | (0,02) |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 17,449 | 26/06/2024 | 100 | (3) | (3) | (0,02) |
| CBK | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 100 | (3) | (3) | (0,02) |
| | Option d'achat - USD contre BRL hors cote | BRL 4,968 | 20/06/2024 | 400 | (17) | (13) | (0,07) |
| | Option de vente - USD contre BRL hors cote | 4,968 | 20/06/2024 | 400 | (17) | (16) | (0,08) |
| DUB | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | TRY 40,385 | 28/10/2024 | 26 | (3) | (2) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,385 | 28/10/2024 | 26 | (3) | (3) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 40,250 | 30/10/2024 | 26 | (3) | (2) | (0,01) |
| GLM | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,250 | 30/10/2024 | 26 | (3) | (3) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 39,800 | 31/10/2024 | 13 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 39,800 | 31/10/2024 | 13 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 40,930 | 07/11/2024 | 13 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 40,930 | 07/11/2024 | 13 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 41,150 | 07/11/2024 | 13 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 41,150 | 07/11/2024 | 13 | (1) | (2) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TRY hors cote | 41,160 | 11/11/2024 | 13 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - USD contre TRY hors cote | 41,160 | 11/11/2024 | 13 | (1) | (2) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 04/03/2024 | 52 | (1) | (2) | (0,01) |
| | Option de vente - USD contre TWD hors cote | 31,000 | 04/03/2024 | 52 | (1) | (2) | (0,01) |
| | JPM | Option d'achat - USD contre IDR hors cote | IDR 14 950,000 | 06/06/2024 | 58 | (2) | (2) |
| Option de vente - USD contre IDR hors cote | | 14 950,000 | 06/06/2024 | 58 | (2) | 0 | 0,00 |
| Option de vente - USD contre TWD hors cote | | TWD 31,000 | 01/03/2024 | 141 | (2) | (4) | (0,02) |
| MYI | Option d'achat - USD contre IDR hors cote | IDR 15 370,000 | 13/08/2024 | 114 | (4) | (3) | (0,02) |
| | Option de vente - USD contre IDR hors cote | 15 370,000 | 13/08/2024 | 114 | (4) | (2) | (0,01) |
| | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | MXN 19,500 | 07/03/2024 | 211 | (2) | 0 | 0,00 |
| SOG | Option d'achat - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 200 | (7) | (7) | (0,03) |
| | Option de vente - USD contre MXN hors cote | 17,449 | 26/06/2024 | 200 | (7) | (7) | (0,03) |
| | Option de vente - EUR contre PLN hors cote | PLN 4,220 | 15/03/2024 | 366 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - EUR contre PLN hors cote | 4,430 | 15/03/2024 | 366 | (2) | (3) | (0,02) |
| | | | | | \$ (103) | \$ (94) | (0,47) |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 % | 18/01/2024 | 200 | \$ (1) | \$ (1) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (2) | \$ (1) | (0,01) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Obligation internationale du gouvernement polonais | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 100 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| JPM | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | 100 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ (2) | \$ 2 | \$ 0 | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|--|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GLM | Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,333 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 30/05/2024 | \$ 170 | ARS 7 557 | \$ (1) | \$ 165 | \$ 164 | 0,81 |
| | Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,282 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 07/06/2027 | 60 | 2 693 | 0 | 60 | 60 | 0,30 |
| | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,051 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 56 | PHP 3 131 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,053 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 161 | 8 940 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | Taux variable égal à SOFR USD composé-OIS à 1 jour plus 0,054 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR PHP à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 20/03/2029 | 4 | 220 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ (1) | \$ 224 | \$ 223 | 1,11 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir ⁽¹⁾ | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/03/2029 | MYR 2 005 | \$ 3 | \$ (1) | \$ 2 | 0,01 |
| | À payer | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,868 | 20/12/2028 | 231 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 3,265 | 14/06/2029 | CLP 11 100 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GST | À recevoir ⁽¹⁾ | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/03/2029 | MYR 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 4 | \$ (2) | \$ 2 | 0,01 |

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| AZD | 03/2024 | \$ 25 | CNH 183 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 | |
| BOA | 01/2024 | CLP 22 646 | \$ 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | COP 1 628 481 | \$ 405 | 0 | (15) | (15) | (0,07) | |
| | 01/2024 | DOP 687 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF 188 034 | 511 | 0 | (31) | (31) | (0,16) | |
| | 01/2024 | ¥ 97 704 | 662 | 0 | (32) | (32) | (0,16) | |
| | 01/2024 | KZT 11 254 | 24 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | NZD 93 | 57 | 0 | (2) | (2) | (0,01) | |
| | 01/2024 | PEN 652 | 176 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | PLN 23 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ 444 | COP 1 698 225 | 0 | (6) | (6) | (0,03) | |
| | 01/2024 | 631 | HUF 221 010 | 6 | 0 | 6 | 0,03 | |
| | 01/2024 | 390 | MXN 6 774 | 8 | 0 | 8 | 0,04 | |
| | 01/2024 | 51 | PLN 213 | 3 | 0 | 3 | 0,02 | |
| | 01/2024 | 29 | TRY 871 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | DOP 867 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | EGP 174 | 5 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | 02/2024 | KZT 1 725 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ 428 | CNY 3 023 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | 5 | KES 797 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | 173 | TRY 5 448 | 5 | 0 | 5 | 0,02 | |
| | 02/2024 | 16 | ZMW 376 | 0 | (1) | (1) | (0,01) | |
| | 02/2024 | ZMW 436 | \$ 19 | 2 | 0 | 2 | 0,01 | |
| | 03/2024 | CNH 339 | 47 | 0 | (1) | (1) | (0,01) | |
| | 03/2024 | COP 1 698 225 | 438 | 6 | 0 | 6 | 0,03 | |
| | 03/2024 | DOP 696 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | EGP 273 | 8 | 1 | 0 | 1 | 0,01 | |
| | 03/2024 | IDR 314 642 | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | INR 292 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | MYR 917 | 194 | 0 | (7) | (7) | (0,04) | |
| | 03/2024 | \$ 194 | CNH 1 410 | 5 | 0 | 5 | 0,03 | |
| | 04/2024 | MYR 3 023 | \$ 661 | 0 | (3) | (3) | (0,02) | |
| | 06/2024 | \$ 13 | BRL 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 06/2024 | 5 | KES 804 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 06/2024 | 44 | KRW 57 478 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | 06/2024 | 18 | MXN 314 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | BPS | 01/2024 | BRL 425 | \$ 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 01/2024 | EGP 625 | 18 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | 01/2024 | € 22 | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 01/2024 | HUF 156 603 | 447 | 0 | (6) | (6) | (0,03) |
| | | 01/2024 | ILS 6 236 | 1 753 | 21 | 0 | 21 | 0,10 |
| | | 01/2024 | ¥ 70 369 | 483 | 0 | (18) | (18) | (0,08) |
| | | 01/2024 | PEN 51 | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 01/2024 | PLN 105 | 24 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | | 01/2024 | \$ 16 | € 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 01/2024 | 27 | HUF 9 654 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2024 | | 676 | ILS 2 582 | 42 | 0 | 42 | 0,21 | |
| 01/2024 | | 400 | ¥ 56 400 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 01/2024 | | 23 | NZD 38 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| 01/2024 | | 155 | PLN 649 | 11 | 0 | 11 | 0,05 | |
| 01/2024 | | ZAR 7 639 | \$ 418 | 5 | (4) | 1 | 0,00 | |
| 02/2024 | | EGP 419 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 02/2024 | | KZT 3 101 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 02/2024 | | \$ 760 | CNY 5 392 | 3 | 0 | 3 | 0,01 | |
| 02/2024 | | 7 | EGP 253 | 0 | (1) | (1) | (0,01) | |
| 02/2024 | | 153 | TWD 4 861 | 8 | 0 | 8 | 0,04 | |
| 03/2024 | | CNH 154 | \$ 21 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| 03/2024 | | IDR 2 174 125 | 138 | 0 | (3) | (3) | (0,01) | |
| 03/2024 | | INR 1 013 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | | THB 817 | 23 | 0 | (1) | (1) | (0,01) | |
| 03/2024 | | TWD 2 866 | 93 | 0 | (2) | (2) | (0,01) | |
| 03/2024 | | \$ 457 | CNH 3 317 | 12 | 0 | 12 | 0,06 | |
| 03/2024 | | 20 | IDR 304 759 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | | 36 | ILS 130 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | | 21 | THB 746 | 1 | 0 | 1 | 0,01 | |
| 03/2024 | | 480 | TWD 15 088 | 21 | 0 | 21 | 0,10 | |
| 06/2024 | | 360 | KRW 470 237 | 6 | 0 | 6 | 0,03 | |
| 12/2024 | | 29 | EGP 1 398 | 0 | (1) | (1) | (0,01) | |
| BRC | | 01/2024 | PLN 172 | \$ 41 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | | 01/2024 | \$ 20 | AUD 30 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | 01/2024 | 28 | HUF 9 618 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 01/2024 | 36 | MXN 623 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 01/2024 | 435 | PLN 1 902 | 50 | 0 | 50 | 0,24 |
| | | 01/2024 | 629 | TRY 19 128 | 9 | 0 | 9 | 0,05 |
| | | 02/2024 | 97 | 3 045 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | | 03/2024 | RSD 6 017 | \$ 56 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | 03/2024 | \$ 24 | CZK 532 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 03/2024 | 33 | SGD 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 03/2024 | 0 | THB 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | 03/2024 | 174 | TRY 5 462 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | | 04/2024 | 28 | 892 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | 371 | KRW 484 693 | 6 | 0 | 6 | 0,03 | |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BSH | 02/2024 | CLP 245 701 | \$ 277 | \$ 0 | \$ (4) | \$ (4) | (0,02) |
| | 02/2024 | ¥ 40 000 | 285 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL 5 225 | 1 073 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 01/2024 | CLP 134 636 | 155 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | COP 1 430 518 | 358 | 0 | (11) | (11) | (0,05) |
| | 01/2024 | € 13 | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 993 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 15 900 | 112 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN 2 974 | 169 | 0 | (5) | (5) | (0,03) |
| | 01/2024 | PLN 373 | 89 | 0 | (6) | (6) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 21 | AUD 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 52 | BRL 255 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 46 | CAD 61 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 178 | CLP 157 548 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 01/2024 | 173 | COP 678 998 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 01/2024 | 22 | EGP 736 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 114 | ¥ 16 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 742 | MXN 30 937 | 78 | 0 | 78 | 0,38 |
| | 01/2024 | 8 | NOK 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 201 | PLN 864 | 20 | 0 | 20 | 0,09 |
| | 01/2024 | 10 | ZMW 238 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 7 254 | \$ 385 | 0 | (11) | (11) | (0,06) |
| | 02/2024 | BRL 255 | 52 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP 840 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 31 | EGP 1 071 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 02/2024 | 57 | UYU 2 264 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP 158 197 | \$ 178 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR 340 201 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ 10 000 | 71 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN 850 | 226 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 78 | IDR 1 207 916 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 211 | ILS 767 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 03/2024 | 84 | PEN 312 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | ZMW 159 | \$ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ 1 073 | BRL 5 278 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 04/2024 | 22 | KES 3 597 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | £ 29 | \$ 36 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ 52 | BRL 258 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | 15 | KES 2 595 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2024 | 18 | MXN 314 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2024 | 32 | COP 139 584 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 12/2024 | 14 | EGP 659 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2025 | 32 | COP 141 056 | 2 | 0 | 2 | 0,01 | |
| 04/2025 | 32 | 143 520 | 2 | 0 | 2 | 0,01 | |
| 10/2025 | 16 | 77 952 | 2 | 0 | 2 | 0,01 | |
| DUB | 01/2024 | HUF 9 583 | \$ 26 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 01/2024 | NGN 3 075 | 5 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 01/2024 | \$ 3 | PLN 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 14 | ZAR 285 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 01/2024 | 7 | ZMW 175 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 128 | EGP 4 496 | 0 | (13) | (13) | (0,06) |
| | 03/2024 | 1 490 | SGD 1 972 | 10 | 0 | 10 | 0,05 |
| | 04/2024 | 10 | KES 1 553 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | 403 | KRW 523 996 | 5 | 0 | 5 | 0,03 |
| | 08/2024 | € 185 | PLN 854 | 10 | 0 | 10 | 0,05 |
| | 10/2024 | \$ 9 | TRY 357 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2024 | ¥ 7 872 | \$ 56 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 02/2024 | CNY 374 | 52 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | FAR GLM | 01/2024 | CHF 70 | 79 | 0 | (3) | (3) |
| 01/2024 | | COP 279 906 | 66 | 0 | (6) | (6) | (0,03) |
| 01/2024 | | DOP 7 841 | 136 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 01/2024 | | EGP 1 105 | 29 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| 01/2024 | | HUF 38 361 | 103 | 0 | (7) | (7) | (0,04) |
| 01/2024 | | MXN 20 284 | 1 158 | 0 | (35) | (35) | (0,17) |
| 01/2024 | | \$ 978 | BRL 4 970 | 47 | 0 | 47 | 0,23 |
| 01/2024 | | 73 | COP 279 906 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2024 | | 37 | MXN 652 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2024 | | 230 | TRY 6 975 | 3 | 0 | 3 | 0,02 |
| 02/2024 | | DOP 881 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2024 | | EGP 2 266 | 65 | 7 | 0 | 7 | 0,04 |
| 02/2024 | | KZT 2 905 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2024 | | \$ 26 | KZT 12 071 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2024 | | 22 | TRY 670 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2024 | | UYU 1 537 | \$ 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2024 | | DOP 10 832 | 189 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| 03/2024 | | PHP 105 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2024 | | \$ 21 | IDR 325 060 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2024 | | 14 | TRY 433 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2024 | 55 | TWD 1 700 | 2 | 0 | 2 | 0,01 | |
| 04/2024 | DOP 863 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 08/2024 | \$ 26 | COP 112 372 | 2 | 0 | 2 | 0,01 | |
| 10/2024 | 9 | TRY 362 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 11/2024 | \$ 56 | ¥ 7 881 | \$ 3 | \$ 0 | \$ 3 | 0,01 |
| | 11/2024 | 19 | TRY 757 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 04/2025 | 66 | COP 301 521 | 6 | 0 | 6 | 0,03 |
| IND | 03/2024 | CNY 141 | \$ 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ 82 | TWD 2 110 | 0 | (11) | (11) | (0,06) |
| JPM | 01/2024 | BRL 221 | \$ 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | EGP 626 | 18 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 118 387 | 338 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 01/2024 | PLN 256 | 59 | 0 | (6) | (6) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 46 | BRL 222 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 32 | EGP 1 065 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 153 | MXN 2 627 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 01/2024 | 134 | PLN 559 | 8 | 0 | 8 | 0,04 |
| | 01/2024 | 103 | TRY 3 056 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZMW 826 | \$ 36 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 02/2024 | EGP 455 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT 1 305 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 138 | BRL 678 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 02/2024 | 4 | EGP 127 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | 1 781 | INR 148 774 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 02/2024 | 8 | TRY 237 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP 37 874 | \$ 42 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH 1 645 | 227 | 0 | (5) | (5) | (0,03) |
| | 03/2024 | INR 304 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 47 | IDR 729 279 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 546 | TWD 16 961 | 17 | 0 | 17 | 0,08 |
| | 04/2024 | KES 7 223 | \$ 47 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 04/2024 | \$ 46 | BRL 223 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | 24 | KES 3 924 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | 8 | IDR 120 000 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | 361 | KRW 468 071 | 3 | 0 | 3 | 0,02 |
| | 08/2024 | PLN 852 | € 185 | 0 | (9) | (9) | (0,05) |
| | 08/2024 | \$ 56 | COP 242 186 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 09/2024 | € 36 | PLN 171 | 3 | 0 | 3 | 0,02 |
| | 09/2024 | PLN 79 | € 17 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 12/2024 | \$ 18 | EGP 872 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 127 | \$ 94 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 01/2024 | € 1 272 | 1 395 | 0 | (10) | (10) | (0,05) |
| | 01/2024 | HUF 110 940 | 302 | 0 | (18) | (18) | (0,09) |
| | 01/2024 | ¥ 66 700 | 467 | 0 | (7) | (7) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 24 | AUD 36 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 25 | CAD 34 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 41 | EGP 1 358 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 14 | € 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 10 000 | \$ 70 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 15 | EGP 556 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH 2 110 | \$ 291 | 0 | (7) | (7) | (0,04) |
| | 03/2024 | \$ 321 | PHP 17 974 | 3 | 0 | 3 | 0,02 |
| MYI | 03/2024 | 75 | TRY 2 354 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | EGP 654 | \$ 18 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 15 932 | 45 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 37 114 | 252 | 0 | (13) | (13) | (0,06) |
| | 01/2024 | MYR 341 | 73 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | NGN 3 075 | 5 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 01/2024 | PLN 52 | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 31 | EGP 1 035 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | 24 | KZT 11 205 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 21 | MYR 98 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 23 | PLN 92 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 27 | ZAR 488 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP 259 | \$ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT 4 277 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 446 | CNY 3 157 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 11 | EGP 404 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 02/2024 | 11 | KZT 5 093 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | MXN 270 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 761 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 24 | CNH 175 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 4 | EGP 137 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | 718 | IDR 11 051 398 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 06/2024 | £ 29 | \$ 36 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ 73 | £ 58 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 06/2024 | 232 | KRW 301 328 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 06/2024 | 36 | MXN 628 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2024 | 21 | IDR 322 770 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 04/2024 | 42 | MXN 751 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 06/2024 | KRW 25 775 | \$ 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 03/2024 | IDR 296 298 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 24 | IDR 369 990 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | € 4 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 59 | BRL 291 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 23 | CHF 20 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 0 | EGP 13 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 086 | MYR 5 074 | 21 | 0 | 21 | 0,11 |
| | 01/2024 | 7 | NGN 5 754 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | 36 | TRY 1 076 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 17 | ZMW 417 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | EGP 1 244 | \$ 34 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 02/2024 | MYR 968 | 208 | 0 | (3) | (3) | (0,02) |
| | 02/2024 | \$ 4 | KES 638 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 165 | \$ 23 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 661 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 767 | 25 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 4 | EGP 136 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | 14 | IDR 212 126 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 936 | THB 32 362 | 18 | 0 | 18 | 0,09 |
| | 03/2024 | 246 | TWD 7 766 | 11 | 0 | 11 | 0,06 |
| | 06/2024 | KES 3 226 | \$ 21 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 06/2024 | \$ 236 | KRW 305 968 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 08/2024 | 25 | COP 108 200 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 12/2024 | 14 | EGP 668 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 01/2024 | 18 | 586 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | KZT 3 799 | \$ 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 355 | RON 1 627 | 6 | 0 | 6 | 0,03 |
| | 03/2024 | 42 | CNY 298 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 27 | BRL 134 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 133 | CLP 117 642 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 03/2024 | 39 | INR 3 263 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | 30 | KRW 38 429 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | HUF 6 515 | \$ 17 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH 101 | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 136 | 172 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 50 534 | 135 | 0 | (12) | (12) | (0,06) |
| | 01/2024 | PLN 214 | 51 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 94 | HUF 34 665 | 6 | 0 | 6 | 0,03 |
| | 01/2024 | 249 | MXN 4 400 | 10 | 0 | 10 | 0,05 |
| | 01/2024 | 36 | NOK 388 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 01/2024 | 24 | ZAR 453 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 02/2024 | ¥ 150 000 | \$ 1 008 | 0 | (65) | (65) | (0,32) |
| | 03/2024 | 30 000 | 214 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 627 | CZK 13 955 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| | 03/2024 | 68 | INR 5 675 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 616 | \$ (483) | \$ 133 | 0,67 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 282 1,41

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| CERTIFICATS DE DÉPÔT | | | |
| Banco Davivienda S.A. | | | |
| 10,942 % éch. 28/04/2026 | COP 10 000 | \$ 3 | 0,01 |
| 11,679 % éch. 12/05/2025 | 124 400 | 32 | 0,16 |
| 12,950 % éch. 08/03/2026 | 89 415 | 24 | 0,12 |
| 13,183 % éch. 06/06/2026 | 77 000 | 21 | 0,11 |
| 13,455 % éch. 09/06/2025 | 35 000 | 9 | 0,04 |
| 13,455 % éch. 13/06/2025 | 51 000 | 14 | 0,07 |
| 13,456 % éch. 07/06/2025 | 105 000 | 28 | 0,14 |
| 13,501 % éch. 13/12/2024 | 91 000 | 24 | 0,12 |
| 15,389 % éch. 21/02/2024 | 30 000 | 8 | 0,04 |
| Bancolombia S.A. | | | |
| 5,917 % éch. 27/01/2024 | 141 800 | 37 | 0,19 |
| 10,388 % éch. 20/04/2026 | 165 900 | 43 | 0,22 |
| 13,320 % éch. 08/06/2025 | 47 000 | 12 | 0,06 |
| 13,456 % éch. 14/06/2025 | 85 000 | 23 | 0,12 |
| 13,637 % éch. 14/12/2024 | 124 000 | 32 | 0,16 |
| 16,137 % éch. 01/09/2024 | 51 000 | 13 | 0,07 |
| BBVA Colombia S.A. | | | |
| 13,093 % éch. 28/04/2026 | 45 000 | 12 | 0,06 |
| 13,229 % éch. 10/05/2026 | 20 000 | 5 | 0,02 |
| 13,365 % éch. 04/05/2026 | 29 000 | 8 | 0,04 |
| 14,460 % éch. 13/01/2024 | 58 400 | 15 | 0,07 |
| Total des Certificats de dépôt | | \$ 363 | 1,82 |
| Total des Investissements | | \$ 20 541 | 102,98 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (595) | (2,98) |
| Actifs nets | | \$ 19 946 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,99 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|--------------|--------|--------------|---------------------|
| Development Bank of Southern Africa 8,600 % éch. 21/10/2024 | 07/10/2021 | \$ 215 | \$ 174 | 0,87 |
| DrillCo Holding Lux S.A. | 08/06/2023 | 16 | 19 | 0,10 |
| Flourish Century 6,600 % éch. 04/02/2022 | 25/08/2021 | 197 | 18 | 0,09 |
| | | \$ 428 | \$ 211 | 1,06 |

Un montant en numéraire de 305 \$ (31 décembre 2022 : 282 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 17 495 | \$ 268 | \$ 17 763 |
| Fonds d'investissement | 311 | 1 526 | 0 | 1 837 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 158 | 0 | 158 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 5 | 415 | 0 | 420 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 363 | 0 | 363 |
| Totaux | \$ 316 | \$ 19 957 | \$ 268 | \$ 20 541 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 15 014 | \$ 250 | \$ 15 264 |
| Fonds d'investissement | 205 | 1 853 | 0 | 2 058 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 2 766 | 0 | 2 766 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | 993 | 0 | 993 |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 34 | 44 | 78 |
| Totaux | \$ 205 | \$ 20 660 | \$ 294 | \$ 21 159 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ (72) | \$ 0 | \$ (72) | \$ 95 | \$ 0 | \$ 95 |
| BPS | 92 | 0 | 92 | (152) | 0 | (152) |
| BRC | 63 | 0 | 63 | 21 | 0 | 21 |
| BSH | (5) | 0 | (5) | S/O | S/O | S/O |
| CBK | 43 | 0 | 43 | 98 | 0 | 98 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (4) | 0 | (4) |
| DUB | 5 | 0 | 5 | 13 | 0 | 13 |
| FAR | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 228 | (270) | (42) | 404 | (270) | 134 |
| IND | (11) | 0 | (11) | (9) | 0 | (9) |

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| JPM | \$ 27 | \$ 0 | \$ 27 | \$ 49 | \$ 0 | \$ 49 |
| MBC | (44) | 0 | (44) | (34) | 0 | (34) |
| MYC | S/O | S/O | S/O | (14) | 0 | (14) |
| MYI | (33) | 0 | (33) | 25 | 0 | 25 |
| RBC | 1 | 0 | 1 | 1 | 0 | 1 |
| SCX | 54 | 0 | 54 | 124 | 0 | 124 |
| SOG | 1 | 0 | 1 | 38 | 0 | 38 |
| SSB | 3 | 0 | 3 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (2) | 0 | (2) | (213) | 0 | (213) |
| UAG | (67) | 0 | (67) | 116 | 0 | 116 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 77,08 | 27,93 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 10,53 | 44,26 |
| Autres valeurs mobilières | 1,44 | 0,70 |
| Fonds d'investissement | 9,21 | 9,83 |
| Contrats de mise en pension | 0,79 | 13,22 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,03 | 0,09 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,67 | 1,99 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 1,41 | 2,67 |
| Certificats de dépôt | 1,82 | 0,37 |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Argentine | S/O | 0,22 |
| Azerbaïdjan | 1,00 | 0,93 |
| Brésil | 1,13 | 2,81 |
| Îles Caïmans | 0,05 | 0,21 |
| Chili | 3,12 | 0,03 |
| Chine | 0,55 | 0,11 |
| Colombie | 1,99 | 1,99 |
| République tchèque | 0,48 | 0,85 |
| Danemark | 0,00 | 1,89 |
| République dominicaine | 2,24 | 0,31 |
| Équateur | 0,33 | S/O |
| Hongrie | 0,15 | 0,93 |
| Indonésie | S/O | 0,00 |
| Irlande | 1,30 | 1,52 |
| Israël | 1,13 | 2,07 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,55 | 0,51 |
| Luxembourg | 0,26 | 0,13 |
| Malaisie | 0,45 | S/O |
| Île Maurice | S/O | 0,87 |
| Mexique | 2,52 | 1,62 |
| Pays-Bas | S/O | 0,05 |
| Pérou | 2,75 | 1,60 |
| Pologne | 2,17 | 0,37 |
| Qatar | S/O | 0,45 |
| Roumanie | 0,68 | S/O |
| Afrique du Sud | 7,68 | 3,99 |
| Corée du Sud | 1,01 | S/O |
| Thaïlande | 0,01 | S/O |
| Royaume-Uni | 0,64 | 1,48 |
| États-Unis | 4,54 | 5,71 |
| Uruguay | 0,11 | S/O |
| Zambie | 0,19 | 0,13 |
| Instruments à court terme | 52,02 | 42,11 |
| Fonds d'investissement | 9,21 | 9,83 |
| Contrats de mise en pension | 0,79 | 13,22 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,03 | 0,09 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,08) | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,75 | 1,99 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Options de change | 0,10 | 0,13 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Options vendues | | |
| Options de change | (0,47) | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,01) | S/O |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps sur devises croisées | 1,11 | 1,01 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | 0,00 |
| Swaps de volatilité | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | 0,67 | 1,53 |
| Certificats de dépôt | 1,82 | 0,37 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (2,98) | (1,06) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ZF Finance GmbH | | | | Pinnacle Bidco PLC | € 250 | \$ 288 | 0,11 | TDC Net A/S | € 300 | \$ 345 | 0,13 |
| 2,000 % éch. 06/05/2027 | 400 | 410 | 0,15 | 8,250 % éch. 11/10/2028 | | | | 5,056 % éch. 31/05/2028 | | | |
| 2,250 % éch. 03/05/2028 | 100 | 102 | 0,04 | RELX Capital, Inc. | \$ 800 | 807 | 0,30 | 5,618 % éch. 06/02/2030 | 2 700 | 3 083 | 1,14 |
| | | 56 035 | 20,66 | ReNew Power Pvt Ltd. | | | | TerraForm Power Operating LLC | | | |
| | | | | 5,875 % éch. 05/03/2027 | 200 | 191 | 0,07 | 5,000 % éch. 31/01/2028 | \$ 230 | 224 | 0,08 |
| INDUSTRIE | | | | S&P Global, Inc. | | | | Verizon Communications, Inc. | | | |
| Accor S.A. | | | | 2,700 % éch. 01/03/2029 | 700 | 648 | 0,24 | 2,850 % éch. 03/09/2041 | 300 | 222 | 0,08 |
| 2,375 % éch. 29/11/2028 | 900 | 950 | 0,35 | Schaeffler AG | € 200 | 215 | 0,08 | 5,050 % éch. 09/05/2033 | 1 500 | 1 531 | 0,56 |
| Amgen, Inc. | | | | 3,375 % éch. 12/10/2028 | € 200 | 215 | 0,08 | Vodafone Group PLC | | | |
| 5,600 % éch. 02/03/2043 | \$ 900 | 931 | 0,34 | SK Hynix, Inc. | | | | 5,125 % éch. 04/06/2081 | 113 | 86 | 0,03 |
| Arcadis NV | | | | 6,375 % éch. 17/01/2028 | \$ 600 | 620 | 0,23 | | | 14 030 | 5,17 |
| 4,875 % éch. 28/02/2028 | € 200 | 229 | 0,08 | Standard Industries, Inc. | | | | Total Obligations et billets privés | | 93 141 | 34,34 |
| Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC | | | | 2,250 % éch. 21/11/2026 | € 600 | 629 | 0,23 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| 3,000 % éch. 01/09/2029 | 600 | 536 | 0,20 | Tesco Corporate Treasury Services PLC | | | | Fannie Mae | | | |
| Ball Corp. | | | | 0,375 % éch. 27/07/2029 | 300 | 282 | 0,10 | 3,500 % éch. 01/08/2059 | 2 977 | 2 705 | 1,00 |
| 3,125 % éch. 15/09/2031 | \$ 580 | 501 | 0,18 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV | | | | 4,000 % éch. 01/11/2059 | 129 | 122 | 0,04 |
| BCP Modular Services Finance PLC | | | | 7,875 % éch. 15/09/2031 | 400 | 502 | 0,19 | Ginnie Mae | | | |
| 4,750 % éch. 30/11/2028 | € 100 | 103 | 0,04 | Transurban Finance Co. Pty. Ltd. | | | | 5,500 % éch. 20/07/2053 | 4 552 | 4 587 | 1,69 |
| Boise Cascade Co. | | | | 2,450 % éch. 16/03/2031 | \$ 500 | 416 | 0,15 | Ginnie Mae, TBA | | | |
| 4,875 % éch. 01/07/2030 | \$ 380 | 357 | 0,13 | Travis Perkins PLC | | | | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 2 500 | 2 483 | 0,92 |
| CDW LLC | | | | 3,750 % éch. 17/02/2026 | £ 400 | 481 | 0,18 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | |
| 3,569 % éch. 01/12/2031 | 500 | 444 | 0,16 | VeriSign, Inc. | | | | 3,000 % éch. 01/07/2052 | 486 | 430 | 0,16 |
| Cellnex Finance Co. S.A. | | | | 2,700 % éch. 15/06/2031 | \$ 650 | 557 | 0,21 | 4,000 % éch. 01/05/2053 | 20 543 | 19 428 | 7,16 |
| 3,875 % éch. 07/07/2041 | 200 | 155 | 0,06 | Vilmorin & Cie S.A. | | | | 4,500 % éch. 01/07/2052 - 01/09/2053 | 7 799 | 7 564 | 2,79 |
| Centene Corp. | | | | 1,375 % éch. 26/03/2028 | € 300 | 281 | 0,10 | 5,000 % éch. 01/08/2053 | 23 829 | 23 580 | 8,69 |
| 3,000 % éch. 15/10/2030 | 600 | 520 | 0,19 | Vmed O2 UK Financing PLC | | | | 5,500 % éch. 01/06/2053 | 28 682 | 28 853 | 10,64 |
| Fair Isaac Corp. | | | | 4,500 % éch. 15/07/2031 | £ 200 | 221 | 0,08 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 4,000 % éch. 15/06/2028 | 610 | 578 | 0,21 | 4,750 % éch. 15/07/2031 | \$ 600 | 536 | 0,20 | 2,000 % éch. 01/02/2054 | 500 | 409 | 0,15 |
| Flex Ltd. | | | | Wabtec Transportation Netherlands BV | | | | 3,500 % éch. 01/02/2054 | 800 | 735 | 0,27 |
| 6,000 % éch. 15/01/2028 | 300 | 310 | 0,11 | 1,250 % éch. 03/12/2027 | € 400 | 408 | 0,15 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 1 400 | 1 406 | 0,52 |
| Ford Motor Co. | | | | Weir Group PLC | | | | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 7 400 | 7 514 | 2,77 |
| 3,250 % éch. 12/02/2032 | 80 | 67 | 0,02 | 2,200 % éch. 13/05/2026 | \$ 400 | 372 | 0,14 | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 5 500 | 5 636 | 2,08 |
| Gap, Inc. | | | | Zenith Finco PLC | | | | | | 105 452 | 38,88 |
| 3,625 % éch. 01/10/2029 | 200 | 171 | 0,06 | 6,500 % éch. 30/06/2027 | £ 200 | 208 | 0,08 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| 3,875 % éch. 01/10/2031 | 300 | 247 | 0,09 | ZF North America Capital, Inc. | | | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b) | | | |
| GN Store Nord A/S | | | | 6,875 % éch. 14/04/2028 | \$ 150 | 156 | 0,06 | 0,125 % éch. 15/07/2024 | 1 788 | 1 757 | 0,65 |
| 0,875 % éch. 25/11/2024 | € 400 | 424 | 0,16 | | | | | 0,125 % éch. 15/10/2024 | 2 027 | 1 983 | 0,73 |
| Graphic Packaging International LLC | | | | | | | | 0,125 % éch. 15/07/2031 | 1 423 | 1 266 | 0,47 |
| 2,625 % éch. 01/02/2029 | 400 | 410 | 0,15 | | | | | 0,125 % éch. 15/01/2032 | 6 882 | 6 048 | 2,23 |
| HCA, Inc. | | | | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | 0,250 % éch. 15/01/2025 | 2 598 | 2 522 | 0,93 |
| 4,500 % éch. 15/02/2027 | \$ 500 | 494 | 0,18 | AES Corp. | | | | 0,500 % éch. 15/04/2024 | 49 | 48 | 0,02 |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. | | | | 2,450 % éch. 15/01/2031 | 300 | 252 | 0,09 | 0,625 % éch. 15/01/2024 | 1 094 | 1 091 | 0,40 |
| 3,625 % éch. 15/02/2032 | 380 | 332 | 0,12 | 5,450 % éch. 01/06/2028 | 700 | 712 | 0,26 | 0,750 % éch. 15/02/2045 | 209 | 164 | 0,06 |
| 4,000 % éch. 01/05/2031 | 200 | 183 | 0,07 | CenterPoint Energy Houston Electric LLC | | | | 1,000 % éch. 15/02/2046 | 532 | 436 | 0,16 |
| InterContinental Hotels Group PLC | | | | 5,300 % éch. 01/04/2053 | 800 | 838 | 0,31 | 1,375 % éch. 15/02/2044 | 832 | 744 | 0,27 |
| 3,375 % éch. 08/10/2028 | £ 500 | 595 | 0,22 | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. | | | | 1,500 % éch. 15/02/2053 | 621 | 564 | 0,21 |
| JCDecaux SE | | | | 4,250 % éch. 25/03/2027 | 180 | 165 | 0,06 | Billets du Trésor américain | | | |
| 1,625 % éch. 07/02/2030 | € 300 | 290 | 0,11 | Enel Finance America LLC | | | | 2,375 % éch. 31/03/2029 | 2 100 | 1 950 | 0,72 |
| JDE Peet's NV | | | | 7,100 % éch. 14/10/2027 | 800 | 854 | 0,32 | 3,875 % éch. 30/09/2029 | 2 400 | 2 396 | 0,88 |
| 2,250 % éch. 24/09/2031 | \$ 600 | 481 | 0,18 | Enel Finance International NV | | | | | | 20 969 | 7,73 |
| 4,125 % éch. 23/01/2030 | € 800 | 910 | 0,34 | 1,375 % éch. 12/07/2026 | 300 | 273 | 0,10 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| John Lewis PLC | | | | 2,250 % éch. 12/07/2031 | 400 | 325 | 0,12 | 1211 Avenue of the Americas Trust | | | |
| 6,125 % éch. 21/01/2025 | £ 200 | 254 | 0,09 | Iberdrola International BV | | | | 4,142 % éch. 10/08/2035 | 1 895 | 1 710 | 0,63 |
| Lenovo Group Ltd. | | | | 6,750 % éch. 15/09/2033 | 250 | 267 | 0,10 | 225 Liberty Street Trust | | | |
| 3,421 % éch. 02/11/2030 | \$ 400 | 354 | 0,13 | India Green Energy Holdings | | | | 4,501 % éch. 10/02/2036 | 1 200 | 1 000 | 0,37 |
| Liberty Utilities Finance GP | | | | 5,375 % éch. 29/04/2024 | 250 | 248 | 0,09 | 245 Park Avenue Trust | | | |
| 2,050 % éch. 15/09/2030 | 300 | 244 | 0,09 | India Green Power Holdings | | | | 3,657 % éch. 05/06/2037 | 1 250 | 1 089 | 0,40 |
| Lindblad Expeditions LLC | | | | 4,000 % éch. 22/02/2027 | 250 | 230 | 0,09 | 280 Park Avenue Mortgage Trust | | | |
| 6,750 % éch. 15/02/2027 | 300 | 299 | 0,11 | National Grid PLC | | | | 6,738 % éch. 15/09/2034 | 2 297 | 2 152 | 0,79 |
| Marks & Spencer PLC | | | | 0,250 % éch. 01/09/2028 | € 400 | 386 | 0,14 | Banc of America Funding Trust | | | |
| 4,500 % éch. 10/07/2027 | £ 350 | 431 | 0,16 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | | | | 6,479 % éch. 25/10/2036 | 60 | 52 | 0,02 |
| Metalsa S.A. de C.V. | | | | 1,900 % éch. 15/06/2028 | \$ 400 | 355 | 0,13 | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust | | | |
| 3,750 % éch. 04/05/2031 | \$ 150 | 124 | 0,05 | 2,200 % éch. 02/12/2026 | AUD 400 | 254 | 0,09 | 0,597 % éch. 10/08/2033 (a) | 9 200 | 77 | 0,03 |
| MSCI, Inc. | | | | Pacific Gas & Electric Co. | | | | 4,216 % éch. 10/08/2033 | 105 | 94 | 0,03 |
| 3,625 % éch. 01/09/2030 | 400 | 362 | 0,13 | 6,700 % éch. 01/04/2053 | \$ 1 300 | 1 414 | 0,52 | 4,498 % éch. 10/08/2035 | 1 600 | 1 401 | 0,52 |
| Nemak S.A.B. de C.V. | | | | PacifiCorp | | | | 4,563 % éch. 10/08/2033 | 2 190 | 1 762 | 0,65 |
| 2,250 % éch. 20/07/2028 | € 400 | 393 | 0,15 | 5,350 % éch. 01/12/2053 | 700 | 674 | 0,25 | 4,957 % éch. 10/08/2035 | 550 | 401 | 0,15 |
| Newell Brands, Inc. | | | | Pattern Energy Operations LP | | | | Bear Stearns ALT-A Trust | | | |
| 4,875 % éch. 01/06/2025 | \$ 200 | 197 | 0,07 | 4,500 % éch. 15/08/2028 | 500 | 473 | 0,17 | 5,790 % éch. 25/06/2046 | 753 | 664 | 0,24 |
| NextEra Energy Operating Partners LP | | | | Southern California Edison Co. | | | | Bridgegate Funding PLC | | | |
| 7,250 % éch. 15/01/2029 | 1 000 | 1 048 | 0,39 | 2,500 % éch. 01/06/2031 | 400 | 343 | 0,13 | 9,220 % éch. 16/10/2062 | £ 950 | 1 208 | 0,45 |
| NXP BV | | | | 3,650 % éch. 01/06/2051 | 200 | 151 | 0,06 | 10,220 % éch. 16/10/2062 | 950 | 1 204 | 0,44 |
| 2,500 % éch. 11/05/2031 | 250 | 213 | 0,08 | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. | | | | Commercial Mortgage Trust | | | |
| 5,000 % éch. 15/01/2033 | 1 000 | 1 002 | 0,37 | 6,750 % éch. 24/04/2033 | 324 | 325 | 0,12 | 3,832 % éch. 10/02/2036 | \$ 3 000 | 2 723 | 1,00 |
| Pearson Funding PLC | | | | | | | | | | | |
| 3,750 % éch. 04/06/2030 | £ 100 | 119 | 0,04 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| British Telecommunications PLC | 1,000 % | 20/06/2028 | € 200 | \$ 4 | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/12/2028 | 900 | 24 | 0,01 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/06/2028 | 100 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 29 | 0,01 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 % | 20/10/2033 | £ 100 | \$ 11 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 1 500 | (153) | (0,06) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/12/2026 | ¥ 330 000 | 11 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 16/06/2028 | 890 000 | 108 | 0,04 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/12/2028 | 1 690 000 | (105) | (0,04) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/06/2032 | 226 300 | 37 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 15/03/2042 | 101 000 | 58 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2028 | \$ 150 | 13 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 16/06/2031 | 100 | 13 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/12/2026 | 6 000 | (522) | (0,19) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/06/2051 | 40 | 9 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,350 | 20/01/2027 | 200 | 16 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360 | 15/02/2027 | 550 | 44 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,380 | 04/01/2027 | 500 | (40) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,418 | 20/01/2027 | 250 | (20) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,420 | 24/02/2027 | 400 | 31 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,425 | 18/01/2027 | 500 | (39) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,443 | 18/01/2027 | 500 | (38) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450 | 17/02/2027 | 500 | 38 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450 | 16/07/2031 | 50 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 800 | (94) | (0,03) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 12/01/2029 | 110 | 12 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,518 | 20/01/2029 | 150 | (16) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,535 | 15/10/2031 | 200 | (30) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,550 | 20/01/2027 | 700 | (50) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,570 | 11/01/2027 | 200 | (15) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,570 | 12/01/2027 | 100 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,573 | 28/02/2027 | 300 | (28) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,580 | 16/02/2027 | 300 | (21) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,600 | 16/01/2026 | 2 700 | 90 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,600 | 15/02/2027 | 2 200 | (151) | (0,06) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,618 | 09/02/2029 | 200 | (24) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,620 | 18/04/2027 | 300 | (26) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 26/01/2029 | 150 | (15) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,650 | 24/02/2027 | 1 300 | (86) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,650 | 08/02/2032 | 250 | (39) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,655 | 24/01/2032 | 150 | (22) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 06/03/2024 | 500 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 17/02/2027 | 2 100 | (136) | (0,05) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 12/01/2029 | 400 | (39) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,730 | 24/02/2032 | 150 | (22) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,735 | 12/01/2032 | 150 | (21) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,765 | 16/03/2032 | 300 | (43) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,770 | 14/02/2032 | 150 | (22) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,783 | 22/04/2027 | 400 | (32) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,785 | 12/08/2051 | 50 | 17 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,788 | 03/05/2027 | 500 | (40) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,815 | 24/01/2052 | 50 | (16) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,817 | 05/04/2032 | 150 | (21) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,867 | 26/01/2052 | 50 | (15) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,872 | 06/04/2032 | 150 | (20) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,888 | 22/03/2029 | 200 | (20) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,928 | 25/03/2027 | 300 | (23) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2027 | 2 820 | (30) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2029 | 2 600 | (29) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 18/02/2032 | 200 | (23) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2032 | 9 850 | (56) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/12/2051 | 200 | (67) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250 | 17/06/2027 | 400 | (24) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,300 | 17/01/2026 | 2 000 | 65 | 0,02 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,350 | 17/01/2025 | 3 500 | 79 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,370 | 21/06/2027 | 400 | (22) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,430 | 30/09/2027 | 460 | 23 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 20/12/2024 | 6 800 | 159 | 0,06 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 04/10/2027 | 460 | 22 | 0,01 |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,468 % | 27/07/2028 | \$ 200 | \$ (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,537 | 24/07/2053 | 100 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,605 | 28/06/2027 | 400 | (18) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,675 | 24/07/2028 | 200 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 3 200 | 275 | 0,10 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,765 | 27/07/2024 | 1 100 | (21) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,850 | 30/08/2027 | 1 000 | (31) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,880 | 30/09/2027 | 1 300 | (33) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,900 | 04/10/2027 | 1 300 | (32) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 500 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,955 | 04/10/2027 | 300 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2030 | 1 570 | 19 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 40 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 07/09/2027 | 600 | (14) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 08/09/2029 | 600 | (15) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 06/09/2032 | 500 | (15) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,052 | 24/07/2024 | 1 100 | (18) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 200 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100 | 09/09/2029 | 600 | (13) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 200 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 200 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 200 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 4 810 | (119) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 06/03/2033 | 200 | (5) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,340 | 23/02/2030 | 400 | (8) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,350 | 14/12/2032 | 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 01/03/2033 | 200 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 12/07/2053 | 200 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400 | 23/02/2033 | 200 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,405 | 01/03/2033 | 300 | (5) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,420 | 24/05/2033 | 300 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,425 | 01/03/2033 | 300 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430 | 27/02/2033 | 300 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450 | 07/03/2033 | 500 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 400 | (5) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/06/2030 | 600 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/05/2033 | 21 620 | (19) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 21/06/2033 | 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 100 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 200 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,610 | 12/12/2032 | 200 | (1) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 400 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 400 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 10/07/2033 | 200 | 2 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 100 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700 | 06/06/2033 | 12 640 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730 | 03/08/2033 | 100 | 2 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 400 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 400 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 10 300 | 178 | 0,07 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 13/12/2027 | 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 4 800 | (60) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 12/07/2033 | 200 | 4 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 100 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,760 | 23/08/2033 | 400 | 9 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 100 | 2 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 30/08/2033 | 200 | 5 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 100 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 100 | 10 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 100 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 200 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870 | 17/10/2053 | 100 | 11 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880 | 16/10/2053 | 100 | 11 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 30/08/2033 | 200 | 7 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 13/09/2033 | 500 | 19 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 200 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 400 | 19 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 200 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,040 | 20/06/2024 | 1 500 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060 | 20/06/2024 | 6 000 | (45) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,140 | 22/06/2024 | 2 500 | (17) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 200 | 12 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165 | 27/09/2033 | 400 | 23 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 300 | 18 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 200 | 12 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200 | 18/10/2033 | 200 | 12 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 200 | 13 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 % | 23/10/2033 | \$ 100 | \$ 6 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 14 400 | 129 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 200 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255 | 23/10/2033 | 100 | 7 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393 | 25/10/2033 | 100 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 100 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 100 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 200 | 17 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 22/05/2025 | 47 760 | (98) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,900 | 06/06/2025 | 27 590 | 58 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,100 | 22/05/2024 | 92 690 | (98) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,400 | 06/06/2024 | 53 540 | 57 | 0,02 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | € 700 | (35) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 400 | (20) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | 400 | 1 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 800 | 2 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 500 | 2 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 400 | 2 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 400 | 2 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | 400 | 15 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 300 | (34) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 200 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 200 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 200 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 100 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 300 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 100 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,970 | 15/12/2033 | 200 | (8) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 200 | (9) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 6 400 | (402) | (0,15) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 100 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,128 | 04/12/2033 | 100 | (6) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 100 | (6) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 100 | (3) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 13 600 | (550) | (0,20) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 06/11/2033 | 200 | (13) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 100 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 08/11/2028 | 200 | (7) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 21/08/2033 | 100 | 7 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 100 | (7) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 400 | 31 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 100 | (7) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 200 | 9 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,450 | 20/10/2028 | 200 | 10 | 0,00 |
| | | | | | \$ (2 362) | (0,87) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (2 333) | (0,86) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,110 % | 26/07/2032 | 200 | \$ 32 | \$ 20 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,110 | 26/07/2032 | 300 | 49 | 67 | 0,02 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,620 | 22/07/2024 | 2 600 | 20 | 2 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,620 | 22/07/2024 | 2 600 | 20 | 33 | 0,01 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,400 | 20/07/2027 | 200 | 26 | 13 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,400 | 20/07/2027 | 200 | 26 | 38 | 0,01 |
| | | | | | | | \$ 173 | \$ 173 | 0,06 |

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 100 | \$ 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,690 | 02/04/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,690 | 02/04/2024 | 100 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,790 | 08/04/2024 | 200 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,790 | 08/04/2024 | 200 | (2) | (3) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 500 | (4) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 500 | (4) | (8) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 | 08/04/2024 | 200 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 200 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 18/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 18/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 200 | (1) | (4) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (46) | \$ (50) | (0,02) |

OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉES

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| MYC | Option d'achat - Taux d'intérêt plafonné à 1 an hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 1 an | 0,026 % | 23/07/2025 | 2 600 | \$ (23) | \$ (36) | (0,02) |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote | LIBOR USD à 1 an | 0,030 | 24/07/2024 | 5 200 | (20) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 1 an | 0,026 | 23/07/2025 | 2 600 | (23) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | \$ (66) | \$ (41) | (0,02) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

(2) Cet instrument sous-jacent a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 % | 20/12/2026 | \$ 1 000 | \$ (44) | \$ 38 | \$ (6) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC | Indice CMBX.NA.AAA.14 Index | 0,500 % | 16/12/2072 | \$ 1 600 | \$ (39) | \$ 23 | \$ (16) | (0,01) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 814 | \$ 539 | \$ 0 | \$ (16) | (0,01) | |
| BOA | 01/2024 | | 814 | 538 | 0 | (17) | (0,01) | |
| | 01/2024 | £ | 538 | 683 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 2 384 | ¥ 351 860 | 113 | 0 | 0,04 | |
| BPS | 01/2024 | € | 551 | \$ 601 | 0 | (7) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 2 050 | 2 601 | 0 | (13) | (0,01) | |
| | 01/2024 | ¥ | 25 700 | 175 | 0 | (7) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 344 | ¥ 50 600 | 15 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | ZAR | 9 848 | \$ 531 | 0 | (7) | 0,00 | |
| CBK | 01/2024 | MXN | 38 | 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 330 | £ 261 | 2 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 422 | MXN 7 749 | 34 | 0 | 0,01 | |
| GLM | 01/2024 | MXN | 7 | \$ 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 148 | ¥ 168 767 | 50 | 0 | 0,02 | |
| | 01/2024 | | 2 624 | MXN 46 028 | 82 | 0 | 0,03 | |
| MBC | 01/2024 | € | 23 613 | \$ 25 947 | 0 | (144) | (0,05) | |
| | 01/2024 | £ | 68 | 86 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 146 400 | 1 027 | 0 | (12) | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | € | 16 | 18 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 907 | ¥ 133 659 | 42 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | IDR | 1 297 927 | \$ 84 | 0 | 0 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | £ | 11 127 | 14 081 | 0 | (104) | (0,04) | |
| | | | | | \$ 338 | \$ (330) | \$ 8 | 0,00 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de distribution et R en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|------|
| AZD | 01/2024 | \$ | 33 419 | AUD 50 400 | \$ 978 | \$ 0 | \$ 978 | 0,36 |
| BOA | 01/2024 | | 2 465 | 3 727 | 79 | 0 | 79 | 0,03 |
| BPS | 01/2024 | AUD | 1 384 | \$ 937 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 554 | AUD 822 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | AUD | 800 | \$ 547 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 558 | AUD 826 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | AUD | 822 | \$ 551 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | \$ | 12 738 | AUD 19 213 | 375 | 0 | 375 | 0,14 |
| RYL | 01/2024 | AUD | 821 | \$ 552 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ | 16 103 | AUD 24 272 | 461 | 0 | 461 | 0,17 |
| | | | | | \$ 1 907 | \$ (26) | \$ 1 881 | 0,70 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--------|
| BRC | 01/2024 | \$ | 59 | CHF 52 | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | (0,01) |
| CBK | 01/2024 | CHF | 2 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 | CHF 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | | 466 | 408 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | | 469 | 409 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | | 422 | 368 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | | | | | \$ 55 | \$ 0 | \$ 55 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 6 865 | \$ 7 503 | \$ 1 | \$ (82) | \$ (81) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 3 370 | € 3 085 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | € 207 | \$ 229 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 450 | € 416 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 2 349 | \$ 2 541 | 0 | (54) | (54) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 36 745 | € 33 420 | 181 | 0 | 181 | 0,07 |
| MYI | 01/2024 | € 111 | \$ 120 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 36 632 | € 33 329 | 193 | 0 | 193 | 0,07 |
| UAG | 01/2024 | 33 626 | 30 570 | 151 | 0 | 151 | 0,06 |
| | | | | \$ 576 | \$ (139) | \$ 437 | 0,16 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 19 | £ 15 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 28 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 3 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | \$ 161 | £ 127 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 105 | 83 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 161 | 127 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 4 | \$ 0 | \$ 4 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 5 952 | NOK 63 288 | \$ 280 | \$ 0 | \$ 280 | 0,11 |
| CBK | 01/2024 | 8 347 | 89 319 | 449 | 0 | 449 | 0,17 |
| GLM | 01/2024 | 7 754 | 83 294 | 449 | 0 | 449 | 0,17 |
| MBC | 01/2024 | 467 | 5 069 | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| RYL | 01/2024 | NOK 803 | \$ 77 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 807 | NOK 29 644 | 114 | (1) | 113 | 0,04 |
| SCX | 01/2024 | 557 | 5 996 | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 357 | \$ (3) | \$ 1 354 | 0,51 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | SEK 1 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 527 | SEK 68 082 | 230 | 0 | 230 | 0,08 |
| CBK | 01/2024 | SEK 1 713 | \$ 164 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 895 | SEK 9 316 | 30 | (1) | 29 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | SEK 582 | \$ 57 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 842 | 82 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | \$ 7 195 | SEK 74 725 | 222 | 0 | 222 | 0,08 |
| UAG | 01/2024 | SEK 1 526 | \$ 152 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 7 228 | SEK 74 601 | 176 | 0 | 176 | 0,07 |
| | | | | \$ 659 | \$ (10) | \$ 649 | 0,24 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 97 | SGD 129 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | 99 | 132 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 13 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 93 | 123 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 3 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 3 | \$ 0 | \$ 3 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 4 451 1,64

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % éch. 01/03/2054 | \$ 500 | \$ (443) | (0,16) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (443) | (0,16) |
| Total des Investissements | | \$ 284 025 | 104,73 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (12 817) | (4,73) |
| Actifs nets | | \$ 271 208 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
 (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
 (c) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
 (d) Titre convertible conditionnel.
 (e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,38 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|--------------------|-------------------------|-----------------|-----------------|------------------------|
| Citigroup, Inc. | 6,075 % | 25/01/2026 | 19/07/2022 | \$ 490 | \$ 497 | 0,18 |
| Deutsche Bank AG | 3,035 | 28/05/2032 | 25/08/2021 - 02/09/2021 | 358 | 293 | 0,11 |
| Standard Chartered PLC | 3,603 | 12/01/2033 | 05/01/2022 | 200 | 166 | 0,06 |
| | | | | \$ 1 048 | \$ 956 | 0,35 |

Un montant en numéraire de 2 915 \$ (31 décembre 2022 : 1 927 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|--|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 274 513 | \$ 13 | \$ 274 526 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 8 200 | 0 | 8 200 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 9 | 1 733 | 0 | 1 742 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (443) | 0 | (443) |
| Totaux | \$ 9 | \$ 284 003 | \$ 13 | \$ 284 025 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|--|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 254 108 | \$ 0 | \$ 254 108 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 44 400 | 0 | 44 400 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (9) | 1 287 | 0 | 1 278 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (2 630) | 0 | (2 630) |
| Totaux | \$ (9) | \$ 297 165 | \$ 0 | \$ 297 156 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 962 | \$ (1 000) | \$ (38) | \$ 4 | \$ 0 | \$ 4 |
| BOA | 684 | (660) | 24 | 43 | 0 | 43 |
| BPS | (64) | 0 | (64) | (571) | 550 | (21) |
| BRC | 2 | 0 | 2 | 59 | 0 | 59 |
| CBK | 520 | (620) | (100) | 1 021 | (950) | 71 |
| DUB | (2) | (10) | (12) | (9) | 0 | (9) |
| GLM | 655 | (510) | 145 | 3 | 260 | 263 |
| GST | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (8) | 0 | (8) | 187 | 0 | 187 |
| MBC | 375 | (260) | 115 | 660 | (350) | 310 |
| MYC | 15 | 0 | 15 | (69) | 0 | (69) |
| MYI | 251 | (450) | (199) | 263 | (20) | 243 |
| RYL | 103 | 0 | 103 | 88 | 0 | 88 |
| SAL | S/O | S/O | S/O | (6) | 0 | (6) |
| SCX | 257 | (300) | (43) | 799 | (780) | 19 |
| SSB | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 701 | (990) | (289) | 164 | 0 | 164 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 39,24 | 36,58 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 61,99 | 69,50 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 0,71 |
| Contrats de mise en pension | 3,02 | 18,66 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,14) | 0,05 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,86) | (0,62) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 1,64 | 1,11 |
| Titres vendus à découvert | (0,16) | (1,11) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 0,31 | 0,52 |
| Obligations et billets privés | 34,34 | 34,38 |
| Agences du gouvernement américain | 38,88 | 29,05 |
| Obligations du Trésor américain | 7,73 | 5,52 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 12,45 | 12,90 |
| Titres adossés à des actifs | 6,12 | 6,03 |
| Émissions souveraines | 1,40 | 1,19 |
| Instruments à court terme | S/O | 17,20 |
| Contrats de mise en pension | 3,02 | 18,66 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,14) | 0,05 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | 0,00 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | (0,01) |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,87) | (0,61) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,06 | 0,08 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (0,10) |
| Options à taux d'intérêt plafonnées | (0,02) | (0,04) |
| Options sur titres | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,02) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | (0,01) | (0,01) |
| Contrats de change à terme | 0,00 | (0,10) |
| Contrats de change à terme couverts | 1,63 | 1,30 |
| Titres vendus à découvert | (0,16) | (1,11) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (4,73) | (24,88) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | |
|---|---|---|--|---|---|---|--|--|-------------------------------|------------------------------------|--|---|--|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | | |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,455 % éch. 08/11/2030 | \$ 214 | € 195 | 0,01 | LeasePlan Corp. NV 1,375 % éch. 07/03/2024 | € 6 100 | € 6 072 | 0,36 | Électricité de France S.A. 2,875 % éch. 15/12/2026 (e) | € 12 800 | € 11 899 | 0,71 | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | BANQUE ET FINANCE | | | | Total Obligations et billets privés | | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | BANQUE ET FINANCE | | | | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN | | | | | |
| Banco di Desio e della Brianza SpA 4,000 % éch. 13/03/2028 | € 5 000 | 5 149 | 0,31 | MUFG Bank Ltd. 3,750 % éch. 10/03/2024 | 1 700 | 1 534 | 0,09 | Fannie Mae 5,692 % éch. 25/07/2037 \$ 5,852 % éch. 25/06/2036 | 4 29 | 4 26 | 0,00 0,00 | | |
| Bank of America Corp. 4,962 % éch. 24/08/2025 | 2 950 | 2 964 | 0,18 | Nordea Kredit Realkreditatieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 1,000 % éch. 01/10/2053 1,500 % éch. 01/10/2050 2,000 % éch. 01/10/2047 2,000 % éch. 01/10/2050 | 10 637 867 0 0 8 261 | 1 067 85 0 0 942 | 0,06 0,01 0,00 0,00 0,06 | Freddie Mac 0,000 % éch. 15/01/2038 (a) 3,500 % éch. 01/10/2047 5,334 % éch. 15/01/2038 5,750 % éch. 01/09/2037 | 423 2 571 423 772 | 20 2 176 377 715 | 0,00 0,00 0,13 0,02 0,04 | | |
| BNP Paribas S.A. 4,500 % éch. 25/02/2030 (e)(g) | 200 | 145 | 0,01 | Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % éch. 27/01/2025 | € 5 200 | 5 177 | 0,31 | Ginnie Mae 5,887 % éch. 20/08/2066 | 4 | 3 | 0,00 | | |
| BPER Banca 0,625 % éch. 28/10/2029 | € 6 600 | 5 899 | 0,35 | Nova Ljubljanska Banka d.d. 10,750 % éch. 28/11/2032 | 5 700 | 6 227 | 0,37 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/10/2029 - 01/08/2041 | | | 553 501 | 0,03 | |
| CaixaBank S.A. 3,625 % éch. 14/09/2028 (e)(g) 6,750 % éch. 13/06/2024 (e)(g) | 200 2 000 | 155 2 002 | 0,01 0,12 | Nykredit Realkredit A/S 0,500 % éch. 01/10/2043 1,000 % éch. 01/01/2024 1,000 % éch. 01/10/2050 1,000 % éch. 01/10/2053 1,500 % éch. 01/10/2037 1,500 % éch. 01/10/2047 1,500 % éch. 01/10/2050 1,500 % éch. 01/10/2053 2,000 % éch. 01/10/2047 2,000 % éch. 01/10/2050 2,000 % éch. 01/10/2053 2,500 % éch. 01/10/2036 2,500 % éch. 01/10/2047 3,000 % éch. 01/10/2053 3,500 % éch. 01/10/2053 5,000 % éch. 01/10/2053 | DKK 8 425 19 500 11 24 0 4 0 6 537 0 57 180 5 632 338 27 4 550 24 673 23 931 | 916 2 616 1 2 0 0 0 713 0 6 524 624 44 3 573 3 206 3 221 | 0,05 0,16 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,04 0,00 0,39 0,04 0,00 0,00 0,03 0,19 0,19 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % éch. 01/02/2054 4,500 % éch. 01/02/2054 6,000 % éch. 01/02/2054 6,500 % éch. 01/02/2054 | | | 49 700 55 200 55 700 35 500 | 42 596 48 473 51 201 32 932 | 2,55 2,90 3,07 1,97 |
| Cooperatieve Rabobank UA 3,250 % éch. 29/12/2026 (e)(g) 4,625 % éch. 29/12/2025 (e)(g) | 1 400 3 800 | 1 250 3 669 | 0,07 0,22 | Realcredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/01/2024 1,500 % éch. 01/10/2047 1,500 % éch. 01/10/2053 2,000 % éch. 01/10/2047 2,000 % éch. 01/10/2050 2,000 % éch. 01/10/2053 2,500 % éch. 01/10/2036 2,500 % éch. 01/10/2047 3,000 % éch. 01/10/2053 3,500 % éch. 01/10/2053 5,000 % éch. 01/10/2053 | 10 637 19 500 11 24 0 4 0 6 537 0 57 180 5 632 338 27 4 550 24 673 23 931 | 1 067 2 616 1 2 0 0 0 713 0 6 524 624 44 3 573 3 206 3 221 | 0,06 0,16 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,04 0,00 0,39 0,04 0,00 0,00 0,03 0,19 0,19 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) 0,125 % éch. 15/07/2024 0,125 % éch. 15/02/2051 0,500 % éch. 15/04/2024 0,500 % éch. 15/01/2028 0,625 % éch. 15/01/2024 1,125 % éch. 15/01/2033 1,375 % éch. 15/07/2033 1,625 % éch. 15/10/2027 2,375 % éch. 15/01/2025 | | | 7 515 6 618 7 442 8 981 5 670 16 113 10 941 29 497 3 101 | 6 687 3 714 6 652 7 696 5 119 13 809 9 610 26 508 2 786 | 0,40 0,22 0,40 0,46 0,31 0,83 0,57 1,58 0,17 |
| Credit Suisse AG 5,185 % éch. 31/05/2024 | 6 800 | 6 824 | 0,41 | Royal Bank of Canada 4,415 % éch. 17/01/2025 | € 5 000 | 5 010 | 0,30 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX Adjustable Rate Mortgage Trust 3,874 % éch. 25/01/2036 | | | 5 4 | 0,00 | |
| Credit Suisse AG AT1 Claim Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025 | \$ 9 500 € 7 700 | 1 032 7 715 | 0,06 0,46 | Société Générale S.A. 1,125 % éch. 21/04/2026 1,250 % éch. 15/02/2024 | 2 400 7 300 | 2 317 7 276 | 0,14 0,44 | Alba PLC 5,509 % éch. 15/12/2038 £ 5,529 % éch. 25/11/2042 | | | 2 883 209 | 3 243 235 | 0,19 0,01 |
| CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025 | 3 200 | 3 018 | 0,18 | UBS Group AG 1,250 % éch. 17/04/2025 3,250 % éch. 02/04/2026 4,194 % éch. 01/04/2031 | 1 600 6 000 2 500 | 1 586 5 948 2 109 | 0,10 0,36 0,13 | American Home Mortgage Investment Trust 6,500 % éch. 25/03/2047 \$ | | | 400 | 257 | 0,02 |
| Deutsche Bank AG 1,000 % éch. 19/11/2025 2,129 % éch. 24/11/2026 (h) | 2 400 \$ 6 600 | 2 335 5 604 | 0,14 0,34 | UniCredit SpA 2,569 % éch. 22/09/2026 3,127 % éch. 03/06/2032 | 9 100 4 400 | 7 749 3 369 | 0,46 0,20 | Atlas Funding PLC 6,348 % éch. 20/01/2061 £ | | | 1 645 | 1 908 | 0,11 |
| DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % éch. 25/01/2027 | € 6 500 | 5 599 | 0,34 | 223 448 | | | 13,37 | Avon Finance PLC 0,000 % éch. 28/12/2049 | | | 4 900 | 5 643 | 0,34 |
| Union européenne 0,450 % éch. 04/07/2041 0,450 % éch. 02/05/2046 0,750 % éch. 04/01/2047 1,625 % éch. 04/12/2029 2,625 % éch. 04/02/2048 | 8 600 930 1 600 3 000 2 000 | 5 645 552 1 014 2 864 1 863 | 0,34 0,03 0,06 0,17 0,11 | INDUSTRIE | | | | Banc of America Funding Trust 6,072 % éch. 20/05/2047 \$ | | | 55 | 45 | 0,00 |
| Fédération des Caisses Desjardins du Québec 2,875 % éch. 28/11/2024 | 3 400 | 3 379 | 0,20 | BMW Finance NV 4,119 % éch. 09/12/2024 | € 10 400 | 10 406 | 0,62 | Barley Hill PLC 6,118 % éch. 27/08/2058 £ | | | 1 068 | 1 229 | 0,07 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % éch. 19/07/2024 2,748 % éch. 14/06/2024 | 3 500 £ 6 500 | 3 451 7 401 | 0,21 0,44 | Fidelity National Information Services, Inc. 0,625 % éch. 03/12/2025 | 1 700 | 1 617 | 0,10 | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,990 % éch. 25/07/2036 \$ 5,142 % éch. 25/07/2033 7,670 % éch. 25/10/2035 | | | 222 3 23 | 144 3 20 | 0,01 0,00 0,00 |
| General Motors Financial Co., Inc. 1,000 % éch. 24/02/2025 | € 3 400 | 3 299 | 0,20 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % éch. 09/07/2024 | 6 000 | 5 923 | 0,35 | Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 3,993 % éch. 26/12/2046 | | | 58 | 40 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 4,956 % éch. 07/02/2025 6,813 % éch. 15/03/2024 | 7 300 \$ 1 700 | 7 307 1 541 | 0,44 0,09 | GN Store Nord A/S 0,875 % éch. 25/11/2024 | 3 300 | 3 163 | 0,19 | Canada Square Funding PLC 6,070 % éch. 17/01/2059 £ | | | 4 127 | 4 735 | 0,28 |
| Hamburg Commercial Bank AG 4,875 % éch. 17/03/2025 | € 3 050 | 3 062 | 0,18 | IMCD NV 2,500 % éch. 26/03/2025 | 2 100 | 2 070 | 0,12 | Charter Mortgage Funding PLC 5,796 % éch. 16/01/2057 | | | 1 293 | 1 493 | 0,09 |
| HSBC Holdings PLC 4,292 % éch. 12/09/2026 | \$ 1 400 | 1 242 | 0,07 | Market Bidco Finco PLC 4,750 % éch. 04/11/2027 | 4 200 | 3 777 | 0,23 | Chase Mortgage Finance Trust 4,457 % éch. 25/01/2036 \$ 6,000 % éch. 25/05/2037 | | | 1 881 90 | 1 543 37 | 0,09 0,00 |
| ING Groep NV 3,875 % éch. 16/05/2027 (e)(g) 4,875 % éch. 16/05/2029 (e)(g) | 200 8 200 | 147 6 163 | 0,01 0,37 | Molnlycke Holding AB 1,875 % éch. 28/02/2025 | 400 | 391 | 0,02 | Citigroup Mortgage Loan Trust 4,318 % éch. 25/03/2034 7,860 % éch. 25/11/2035 | | | 1 13 | 1 12 | 0,00 0,00 |
| Intesa Sanpaolo SpA 2,125 % éch. 26/05/2025 5,500 % éch. 01/03/2028 (e)(g) | € 4 400 250 | 4 314 232 | 0,26 0,01 | Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | 10 150 | 9 349 | 0,56 | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,252 % éch. 25/08/2035 | | | 221 | 185 | 0,01 |
| Jyske Realkredit A/S 0,375 % éch. 01/07/2024 1,000 % éch. 01/10/2050 1,500 % éch. 01/10/2037 1,500 % éch. 01/07/2050 1,500 % éch. 01/10/2050 2,000 % éch. 01/10/2047 2,000 % éch. 01/10/2050 | 800 15 0 0 22 0 0 | 787 2 0 0 2 0 0 | 0,05 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 0,00 | 36 696 | | | 2,19 | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates 4,150 % éch. 25/09/2035 | | | 464 | 372 | 0,02 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5,000 % éch. 19/03/2024 | AUD 200 | 124 | 0,01 | | | | | | | | | | |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,000 % éch. 24/02/2025 | \$ 3 300 | 2 888 | 0,17 | | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------|
| Countrywide Alternative Loan Trust | | | | Precise Mortgage Funding PLC | | | | Asset-Backed European Securitisation Transaction | | | | |
| 4,120 % éch. 25/06/2037 | \$ 30 | € 25 | 0,00 | 6,420 % éch. 12/12/2055 | € 2 787 | € 3 219 | 0,19 | Twenty-One BV | € 1 883 | € 1 888 | 0,11 | |
| 5,250 % éch. 25/06/2035 | 3 | 2 | 0,00 | Primrose Residential DAC | | | | Asset-Backed Funding Certificates Trust | \$ 70 | 49 | 0,00 | |
| 5,500 % éch. 25/09/2035 | 1 348 | 739 | 0,04 | 4,626 % éch. 24/03/2061 | € 8 252 | 8 227 | 0,49 | Aurium CLO DAC | € 6 042 | 5 976 | 0,36 | |
| 5,890 % éch. 25/07/2046 | 109 | 86 | 0,01 | 4,876 % éch. 24/10/2061 | 4 921 | 4 893 | 0,29 | 4,695 % éch. 16/01/2031 | 4 589 | 4 540 | 0,27 | |
| 6,000 % éch. 25/03/2036 | 187 | 77 | 0,01 | Residential Accredited Loans, Inc. Trust | | | | Auto ABS French Leases FCT | 4 543 | 4 167 | 0,25 | |
| 6,000 % éch. 25/08/2037 | 291 | 138 | 0,01 | 5,790 % éch. 25/03/2047 | \$ 966 | 774 | 0,05 | Autonoria FCT | 4 346 | 2 876 | 0,17 | |
| 6,012 % éch. 25/12/2035 | 3 | 2 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/07/2036 | 1 214 | 443 | 0,03 | Autonoria Spain | 4 576 | 4 013 | 0,24 | |
| 6,132 % éch. 20/11/2035 | 257 | 209 | 0,01 | 5,830 % éch. 25/06/2046 | 322 | 69 | 0,00 | Bain Capital Euro CLO DAC | 4 733 | 4 664 | 0,28 | |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 44 | 31 | 0,00 | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | \$ 554 | 492 | 0,03 | |
| 3,673 % éch. 20/05/2036 | 45 | 38 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/06/2037 | 315 | 215 | 0,01 | BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | € 99 | 94 | 0,01 | |
| 3,695 % éch. 25/04/2035 | 85 | 55 | 0,00 | Residential Asset Securitization Trust | | | | 1,050 % éch. 15/01/2031 | 1 678 | 1 670 | 0,10 | |
| 6,050 % éch. 25/04/2035 | 101 | 84 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/02/2036 | 1 251 | 860 | 0,05 | 4,685 % éch. 15/01/2031 | 4 569 | 4 519 | 0,27 | |
| 6,110 % éch. 25/03/2035 | 141 | 110 | 0,01 | Residential Mortgage Securities PLC | | | | 4,875 % éch. 15/01/2033 | 2 000 | 1 970 | 0,12 | |
| 6,210 % éch. 25/02/2035 | 142 | 109 | 0,01 | 6,470 % éch. 20/06/2070 | € 3 746 | 4 331 | 0,26 | BNPP AM Euro CLO DAC | 4 615 | 1 021 | 0,06 | |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust | | | | Resloc UK PLC | | | | 4,615 % éch. 15/10/2031 | 1 034 | 1 021 | 0,06 | |
| 5,850 % éch. 25/08/2047 | 3 002 | 2 193 | 0,13 | 4,085 % éch. 15/12/2043 | € 705 | 681 | 0,04 | Bridgepoint CLO DAC | 5 175 | 1 600 | 0,10 | |
| Dilosk RMBS DAC | | | | Ripon Mortgages PLC | | | | Bumper UK Finance PLC | | | | |
| 4,638 % éch. 20/12/2060 | € 4 549 | 4 553 | 0,27 | 5,920 % éch. 28/08/2056 | € 5 881 | 6 767 | 0,41 | 5,698 % éch. 20/12/2030 | € 512 | 591 | 0,04 | |
| 4,752 % éch. 20/02/2060 | 2 883 | 2 884 | 0,17 | RMAC PLC | | | | Cairn CLO DAC | € 4 645 | 4 605 | 0,28 | |
| 4,956 % éch. 20/10/2062 | 3 764 | 3 780 | 0,23 | 0,000 % éch. 15/02/2047 | 4 400 | 5 094 | 0,31 | 4,666 % éch. 25/04/2032 | 1 392 | 1 380 | 0,08 | |
| Dutch Property Finance BV | | | | RMAC Securities PLC | | | | Carlyle Euro CLO DAC | € 4 632 | 5 969 | 0,35 | |
| 4,602 % éch. 28/07/2058 | 2 277 | 2 272 | 0,14 | 5,489 % éch. 12/06/2044 | 54 | 61 | 0,00 | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC | 4 891 | 4 834 | 0,29 | |
| 4,652 % éch. 28/04/2059 | 3 529 | 3 518 | 0,21 | 5,509 % éch. 12/06/2044 | 952 | 1 059 | 0,06 | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | 4 752 | 4 591 | 0,27 | |
| 4,702 % éch. 28/10/2059 | 1 126 | 1 125 | 0,07 | Stanlington PLC | | | | Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC | 4 653 | 901 | 0,05 | |
| 5,202 % éch. 28/04/2050 | 1 387 | 1 381 | 0,08 | 6,170 % éch. 12/06/2045 | 3 254 | 3 752 | 0,23 | Compartment VCL | 4 273 | 4 755 | 0,28 | |
| EMF-UK PLC | | | | Stratton Mortgage Funding PLC | | | | 4,553 % éch. 21/01/2028 | 1 200 | 1 202 | 0,07 | |
| 6,319 % éch. 13/03/2046 | € 3 639 | 4 158 | 0,25 | 6,069 % éch. 25/09/2051 | 2 945 | 3 398 | 0,20 | Contego CLO BV | 4 735 | 3 710 | 0,22 | |
| European Loan Conduit DAC | | | | 6,120 % éch. 12/03/2052 | 4 810 | 5 551 | 0,33 | Contego CLO DAC | 4 642 | 4 519 | 0,27 | |
| 4,994 % éch. 17/02/2030 | € 5 065 | 4 999 | 0,30 | 6,121 % éch. 20/07/2060 | 12 439 | 14 353 | 0,86 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | |
| Eurosail PLC | | | | Structured Asset Mortgage Investments Trust | | | | 4,512 % éch. 25/07/2036 | \$ 52 | 44 | 0,00 | |
| 4,108 % éch. 13/03/2045 | 419 | 417 | 0,03 | 3,907 % éch. 25/02/2036 | \$ 173 | 131 | 0,01 | 5,610 % éch. 25/06/2035 | 3 950 | 3 130 | 0,19 | |
| First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust | | | | 5,850 % éch. 25/06/2036 | 46 | 40 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/06/2047 | 2 822 | 2 415 | 0,14 | |
| 5,207 % éch. 25/03/2035 | \$ 26 | 14 | 0,00 | 5,970 % éch. 19/07/2035 | 2 | 2 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/11/2037 | 1 826 | 1 498 | 0,09 | |
| Glenbeigh Issuer DAC | | | | 6,170 % éch. 19/12/2034 | 49 | 39 | 0,00 | 6,310 % éch. 25/10/2047 | 1 052 | 911 | 0,05 | |
| 4,666 % éch. 24/03/2046 | € 972 | 972 | 0,06 | 6,170 % éch. 19/02/2035 | 61 | 51 | 0,00 | CVC Cordatus Loan Fund DAC | € 3 393 | 3 347 | 0,20 | |
| 4,666 % éch. 24/06/2050 | 2 372 | 2 370 | 0,14 | Towd Point Mortgage Funding PLC | | | | 4,782 % éch. 15/08/2032 | 3 273 | 3 243 | 0,19 | |
| Great Hall Mortgages PLC | | | | 5,891 % éch. 20/10/2051 | € 500 | 575 | 0,04 | Ellington Loan Acquisition Trust | \$ 2 570 | 2 261 | 0,14 | |
| 4,062 % éch. 18/03/2039 | 73 | 72 | 0,01 | 6,365 % éch. 20/10/2051 | 5 616 | 6 488 | 0,39 | ECT Pulse France | € 2 409 | 2 412 | 0,14 | |
| 5,489 % éch. 18/06/2038 | € 14 | 16 | 0,00 | 6,570 % éch. 20/05/2045 | 4 026 | 4 653 | 0,28 | First Franklin Mortgage Loan Trust | \$ 102 | 91 | 0,01 | |
| 5,812 % éch. 18/06/2039 | \$ 27 | 25 | 0,00 | 6,571 % éch. 20/07/2045 | 8 403 | 9 723 | 0,58 | Ginkgo Sales Finance | € 4 051 | 4 063 | 0,24 | |
| GSR Mortgage Loan Trust | | | | Tower Bridge Funding PLC | | | | Harvest CLO DAC | | | | |
| 4,630 % éch. 25/01/2036 | 3 | 3 | 0,00 | 6,000 % éch. 20/11/2063 | 3 455 | 3 979 | 0,24 | 4,605 % éch. 15/10/2031 | 5 471 | 5 380 | 0,32 | |
| HarborView Mortgage Loan Trust | | | | Trinity Square PLC | | | | 4,673 % éch. 20/10/2031 | 4 231 | 4 168 | 0,25 | |
| 5,285 % éch. 19/05/2033 | 3 | 2 | 0,00 | 6,070 % éch. 15/07/2059 | 5 712 | 6 592 | 0,40 | 4,695 % éch. 15/10/2030 | 5 141 | 5 092 | 0,30 | |
| Harbour Energy PLC | | | | Tudor Rose Mortgages | | | | 4,695 % éch. 15/01/2031 | 4 969 | 4 926 | 0,30 | |
| 6,020 % éch. 28/01/2054 | € 3 853 | 4 447 | 0,27 | 5,820 % éch. 20/06/2048 | 4 569 | 5 245 | 0,31 | 4,725 % éch. 15/07/2031 | 5 400 | 5 323 | 0,32 | |
| Hops Hill PLC | | | | Twin Bridges PLC | | | | 4,815 % éch. 15/01/2032 | 5 400 | 5 331 | 0,32 | |
| 6,197 % éch. 21/12/2055 | 5 129 | 5 899 | 0,35 | 5,880 % éch. 12/09/2055 | 4 544 | 5 200 | 0,31 | Invesco Euro CLO DAC | 1 550 | 1 526 | 0,09 | |
| 6,498 % éch. 27/11/2054 | 3 092 | 3 584 | 0,22 | 6,070 % éch. 12/03/2055 | 3 642 | 4 188 | 0,25 | 4,615 % éch. 15/07/2031 | 3 393 | 3 347 | 0,20 | |
| IndyMac Mortgage Loan Trust | | | | 6,470 % éch. 12/12/2054 | 5 327 | 6 157 | 0,37 | Ellington Loan Acquisition Trust | \$ 2 570 | 2 261 | 0,14 | |
| 3,751 % éch. 25/11/2035 | \$ 73 | 61 | 0,00 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | 6,520 % éch. 25/05/2037 | \$ 2 570 | 2 261 | 0,14 | |
| 5,850 % éch. 25/09/2046 | 552 | 426 | 0,03 | 3,847 % éch. 25/05/2037 | \$ 573 | 443 | 0,03 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | 5 762 | 1 858 | 0,11 | |
| Jubilee Place BV | | | | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | 5,762 % éch. 25/02/2047 | 2 349 | 1 858 | 0,11 | |
| 4,985 % éch. 17/10/2057 | € 1 651 | 1 656 | 0,10 | Wells Fargo Alternative Loan Trust | | | | 5,332 % éch. 25/07/2037 | 21 | 17 | 0,00 | |
| Kentmere PLC | | | | | | | | | 222 641 | 13,32 | | |
| 6,020 % éch. 28/01/2042 | € 1 025 | 1 181 | 0,07 | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | | | | | |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC | | | | Accunia European CLO DAC | | | | Accunia European CLO DAC | € 4 442 | 4 438 | 0,27 | |
| 6,320 % éch. 12/06/2057 | 5 094 | 5 893 | 0,35 | 4,915 % éch. 15/07/2030 | € 4 442 | 4 438 | 0,27 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | |
| Mansard Mortgages PLC | | | | 5,770 % éch. 25/07/2036 | \$ 528 | 158 | 0,01 | Adagio CLO DAC | | | | |
| 5,989 % éch. 15/12/2049 | 749 | 853 | 0,05 | 4,882 % éch. 10/10/2031 | € 5 000 | 4 945 | 0,30 | Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | 6 175 | € 36 | 33 | 0,00 |
| MASTR Asset Securitization Trust | | | | Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | Aqueduct European CLO DAC | € 3 620 | 3 594 | 0,22 | |
| 6,000 % éch. 25/06/2036 | \$ 90 | 48 | 0,00 | 6,175 % éch. 25/01/2036 | \$ 36 | 33 | 0,00 | 4,633 % éch. 20/07/2030 | € 3 620 | 3 594 | 0,22 | |
| Miravet SARL | | | | Ares European CLO DAC | | | | 4,575 % éch. 15/04/2030 | 3 116 | 3 091 | 0,19 | |
| 4,806 % éch. 26/05/2065 | € 4 581 | 4 544 | 0,27 | 4,625 % éch. 15/10/2030 | 4 462 | 4 430 | 0,27 | 5,122 % éch. 21/10/2033 | 4 000 | 3 959 | 0,24 | |
| Newgate Funding PLC | | | | 5,122 % éch. 21/10/2033 | 4 000 | 3 959 | 0,24 | Laurelin DAC | € 5 700 | 5 644 | 0,34 | |
| 6,340 % éch. 15/12/2050 | € 214 | 238 | 0,01 | | | | | | | | | |
| Oak PLC | | | | | | | | | | | | |
| 5,840 % éch. 26/02/2065 | 3 381 | 3 913 | 0,23 | | | | | | | | | |
| Paragon Mortgages PLC | | | | | | | | | | | | |
| 6,270 % éch. 15/05/2045 | 398 | 460 | 0,03 | | | | | | | | | |
| Pierpont BTL PLC | | | | | | | | | | | | |
| 6,320 % éch. 21/09/2054 | 4 569 | 5 285 | 0,32 | | | | | | | | | |
| Polaris PLC | | | | | | | | | | | | |
| 5,985 % éch. 23/12/2058 | 2 008 | 2 313 | 0,14 | | | | | | | | | |
| 5,995 % éch. 23/10/2059 | 4 444 | 5 104 | 0,31 | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Lehman XS Trust | | | | Toro European CLO DAC | | | | 2,350 % éch. 30/07/2033 | € 12 400 | € 11 792 | 0,71 |
| 6,500 % éch. 25/06/2046 | \$ 2 274 | € 1 724 | 0,10 | 4,908 % éch. 12/01/2032 | € 3 900 | € 3 869 | 0,23 | 3,150 % éch. 30/04/2033 | 1 254 | 1 275 | 0,08 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | Voya Euro CLO DAC | | | | 3,450 % éch. 30/07/2043 | 9 100 | 9 022 | 0,54 |
| 5,770 % éch. 25/05/2036 | 2 010 | 980 | 0,06 | 4,715 % éch. 15/10/2030 | 2 712 | 2 687 | 0,16 | 3,450 % éch. 30/07/2066 | 9 400 | 8 814 | 0,53 |
| 5,770 % éch. 25/06/2036 | 4 660 | 1 973 | 0,12 | | | 237 134 | 14,19 | 3,550 % éch. 31/10/2033 | 5 870 | 6 148 | 0,37 |
| Man GLG Euro CLO DAC | | | | | | | | 3,900 % éch. 30/07/2039 | 1 600 | 1 696 | 0,10 |
| 4,645 % éch. 15/10/2030 | € 1 583 | 1 573 | 0,09 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | |
| 4,775 % éch. 15/10/2032 | 4 106 | 4 056 | 0,24 | Communauté autonome de Catalogne | | | | | | 386 001 | 23,09 |
| 4,835 % éch. 15/01/2030 | 2 990 | 2 988 | 0,18 | 4,220 % éch. 26/04/2035 | 1 600 | 1 644 | 0,10 | ACTIONS | | | |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | | Obligation internationale du gouvernement belge | | | | TITRES PRIVILÉGIÉS | | | |
| 5,620 % éch. 25/10/2036 | \$ 2 966 | 892 | 0,05 | 1,400 % éch. 22/06/2053 | 18 000 | 12 076 | 0,72 | Nationwide Building Society | | | |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | 1,600 % éch. 22/06/2047 | 14 000 | 10 541 | 0,63 | 10,250 % | | | |
| 5,720 % éch. 25/07/2036 | 335 | 266 | 0,02 | Caisse Française de Financement Local | | | | 903 | | | |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | | 4,016 % éch. 25/02/2025 | 9 600 | 9 584 | 0,57 | 136 | | | |
| 5,610 % éch. 25/12/2036 | 2 689 | 1 184 | 0,07 | Cassa Depositi e Prestiti SpA | | | | 0,01 | | | |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | | | | 5,750 % éch. 05/05/2026 | \$ 6 000 | 5 428 | 0,32 | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | |
| 5,620 % éch. 25/07/2036 | 468 | 386 | 0,02 | Union européenne | | | | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | 3,000 % éch. 04/03/2053 | € 1 210 | 1 188 | 0,07 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | |
| 5,670 % éch. 25/09/2037 | 430 | 376 | 0,02 | 3,375 % éch. 04/10/2038 | 14 820 | 15 579 | 0,93 | 10,900 % éch. | | | |
| 6,175 % éch. 25/01/2036 | 79 | 71 | 0,00 | 3,375 % éch. 04/11/2042 | 1 550 | 1 618 | 0,10 | 04/01/2024 (b)(c) HUF 1 318 000 | | | |
| OCF Euro CLO DAC | | | | Obligation internationale du gouvernement français | | | | BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | |
| 4,785 % éch. 15/01/2032 | € 3 116 | 3 100 | 0,19 | 0,750 % éch. 25/05/2052 | 2 900 | 1 663 | 0,10 | (0,245) % éch. | | | |
| 4,882 % éch. 22/09/2034 | 5 600 | 5 520 | 0,33 | 2,500 % éch. 24/09/2026 | 33 300 | 33 439 | 2,00 | 04/03/2024 (b)(c) ¥ 7 240 000 | | | |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | 2,750 % éch. 25/02/2029 | 48 800 | 49 976 | 2,99 | (0,216) % éch. | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | 3 563 | 3 506 | 0,21 | 3,000 % éch. 25/05/2054 | 3 300 | 3 243 | 0,19 | 22/01/2024 (b)(c) 5 725 000 | | | |
| PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartiment | | | | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | | (0,207) % éch. | | | |
| 4,576 % éch. 26/11/2030 | 1 619 | 1 622 | 0,10 | 1,750 % éch. 30/05/2024 | 5 300 | 5 256 | 0,31 | 05/02/2024 (b)(c) 1 761 000 | | | |
| Red & Black Auto Italy SRL | | | | 1,750 % éch. 01/07/2024 | 20 200 | 20 005 | 1,20 | (0,206) % éch. | | | |
| 4,865 % éch. 28/07/2034 | 4 141 | 4 158 | 0,25 | 2,800 % éch. 01/03/2067 | 15 500 | 11 352 | 0,68 | 13/02/2024 (b)(c) 3 324 000 | | | |
| Red & Black Auto Lease France | | | | 3,850 % éch. 01/09/2049 | 7 500 | 7 086 | 0,42 | (0,197) % éch. | | | |
| 4,556 % éch. 27/06/2035 | 2 500 | 2 504 | 0,15 | 4,100 % éch. 01/02/2029 | 34 700 | 36 393 | 2,18 | 22/01/2024 (b)(c) 555 000 | | | |
| Revocar UG | | | | 4,500 % éch. 01/10/2053 | 13 600 | 13 989 | 0,84 | (0,189) % éch. | | | |
| 4,513 % éch. 21/04/2036 | 3 474 | 3 484 | 0,21 | Korea Housing Finance Corp. | | | | 05/02/2024 (b)(c) 360 000 | | | |
| SC Germany S.A. Compartiment Consumer | | | | 0,723 % éch. 22/03/2025 | 4 500 | 4 347 | 0,26 | (0,188) % éch. | | | |
| 4,578 % éch. 15/09/2037 | 4 500 | 4 519 | 0,27 | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | | 13/02/2024 (b)(c) 1 076 000 | | | |
| SCF Rahoituspalvelut DAC | | | | 2,659 % éch. 24/05/2031 | \$ 9 700 | 7 445 | 0,45 | (0,174) % éch. | | | |
| 4,535 % éch. 25/06/2033 | 5 300 | 5 318 | 0,32 | République d'Allemagne | | | | 18/03/2024 (b)(c) 4 791 000 | | | |
| Sculptor European CLO DAC | | | | 0,000 % éch. 15/08/2050 | € 2 200 | 1 233 | 0,07 | (0,156) % éch. | | | |
| 4,755 % éch. 14/01/2032 | 4 600 | 4 534 | 0,27 | (b)(j) | | | | 18/03/2024 (b)(c) 769 000 | | | |
| Silver Arrow Athlon NL BV | | | | Obligation internationale du gouvernement roumain | | | | 164 426 | | | |
| 4,576 % éch. 26/04/2031 | 1 903 | 1 906 | 0,11 | 2,000 % éch. 28/01/2032 (i) | 7 700 | 5 976 | 0,36 | 167 872 | | | |
| Silver Arrow Merfina SRL | | | | Obligation internationale du gouvernement slovène | | | | Total des Instruments à court terme | | | |
| 4,559 % éch. 20/07/2033 | 1 495 | 1 497 | 0,09 | 0,000 % éch. 12/02/2031 (b) | 6 100 | 5 012 | 0,30 | Total des Valeurs mobilières | | | |
| Silver Arrow S.A. | | | | 1,000 % éch. 06/03/2028 | 3 600 | 3 374 | 0,20 | € 1 547 627 | | | |
| 4,273 % éch. 15/02/2030 | 1 932 | 1 934 | 0,12 | 1,175 % éch. 13/02/2062 | 8 410 | 5 181 | 0,31 | 92,58 | | | |
| SLC Student Loan Trust | | | | 3,125 % éch. 07/08/2045 | 7 000 | 6 960 | 0,42 | ACTIONS | | | |
| 6,481 % éch. 25/11/2042 | \$ 394 | 358 | 0,02 | 3,625 % éch. 11/03/2033 | 1 300 | 1 377 | 0,08 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| SLM Student Loan Trust | | | | 5,250 % éch. 18/02/2024 | \$ 21 451 | 19 392 | 1,16 | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| 4,356 % éch. 25/10/2039 | € 400 | 373 | 0,02 | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds | | | |
| Soundview Home Loan Trust | | | | 0,000 % éch. 16/09/2025 (b) | € 4 400 | 4 165 | 0,25 | PIMCO Euro | | | |
| 5,970 % éch. 25/10/2036 | \$ 4 534 | 3 845 | 0,23 | Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | | Short Maturity | | | |
| Tikehau CLO DAC | | | | 0,100 % éch. 30/04/2031 | 300 | 248 | 0,01 | UCITS ETF (f) | | | |
| 4,844 % éch. 04/08/2034 | € 4 000 | 3 954 | 0,24 | 0,600 % éch. 31/10/2029 | 31 800 | 28 378 | 1,70 | 1 659 200 | | | |
| | | | | 0,850 % éch. 30/07/2037 | 1 100 | 811 | 0,05 | 164 208 | | | |
| | | | | 1,900 % éch. 31/10/2052 | 19 200 | 13 295 | 0,79 | 98,82 | | | |
| | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement | | | |
| | | | | | | | | € 164 208 | | | |
| | | | | | | | | 9,82 | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net | |
|--|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|---|--|------------------------|-------------|
| COM | 3,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | € 95 300 | State of North Rhine-Westphalia | (99 142) | € 95 300 | € 95 338 | 5,70 | |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 2 520 | Billets du Trésor américain | (2 327) | 2 281 | 2 282 | 0,14 | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | € (101 469) | € 97 581 | € 97 620 | 5,84 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Court | 09/2025 | 640 | € (496) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Long | 09/2026 | 640 | 393 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Long | 03/2024 | 2 895 | 5 240 | 0,31 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 1 011 | 3 244 | 0,19 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 185 | (116) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 379 | 3 787 | 0,23 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 502 | 3 309 | 0,20 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 2 017 | (207) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 591 | (860) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 2 535 | (5 431) | (0,32) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 731 | 4 906 | 0,29 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 389 | (1 507) | (0,09) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 117 | 956 | 0,06 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 403 | (4 182) | (0,25) |
| | | | | € 9 036 | 0,54 |

OPTIONS VENDUES**OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE**

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|-----------------|-------------------|------------------|--------|--------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation EUREX Euro-Bund février 2024 | € 137,000 | 26/01/2024 | 73 | € (50) | € (103) | (0,01) |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

€ 8 933 0,53

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,865 % | 13/02/2054 | \$ 19 400 | € 1 003 | 0,06 |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,085 | 13/02/2034 | 59 500 | (1 147) | (0,07) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 25 400 | 40 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,827 | 15/12/2025 | 31 400 | (266) | (0,02) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,700 | 15/03/2073 | € 4 900 | 343 | 0,02 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 21/09/2037 | 44 600 | 290 | 0,02 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 21/09/2042 | 20 400 | (163) | (0,01) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 88 500 | (10 361) | (0,62) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 241 950 | 15 070 | 0,90 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2044 | 2 000 | (253) | (0,01) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 29 900 | 1 107 | 0,07 |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 182 000 | 219 | 0,01 |
| | | | | | € 5 882 | 0,35 |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

€ 5 882 0,35

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)**

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES**SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT**

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 % | 16/01/2024 | 31 400 | € (138) | € (396) | (0,02) |
| BRC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 3,150 | 06/10/2025 | 24 800 | (272) | (583) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,150 | 06/10/2025 | 24 800 | (272) | (94) | (0,01) |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,950 | 15/09/2025 | 20 600 | (234) | (435) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,950 | 15/09/2025 | 20 600 | (234) | (102) | (0,01) |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,900 | 29/08/2025 | 12 900 | (153) | (256) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,900 | 29/08/2025 | 12 900 | (154) | (59) | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,800 | 01/09/2025 | 27 900 | (326) | (515) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,800 | 01/09/2025 | 27 900 | (326) | (140) | (0,01) |
| | | | | | | | € (2 109) | € (2 580) | (0,15) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 16 800 | € (655) | € 710 | € 55 | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BOA | 01/2024 | € 1 188 | £ 1 024 | € 0 | € (7) | € (7) | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 2 121 000 | € 13 520 | 0 | (148) | (148) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH 101 408 | \$ 14 106 | 0 | (196) | (196) | (0,01) |
| | 06/2024 | KRW 9 136 912 | 7 023 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD 215 | € 131 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 985 | £ 846 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | 12 008 | \$ 13 072 | 0 | (177) | (177) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 1 187 | € 1 377 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 357 786 | \$ 1 019 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 131 378 | 100 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 100 | BRL 491 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 175 | € 3 805 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 | HUF 928 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 250 | IDR 3 867 095 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 6 465 | ZAR 119 852 | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 325 562 | \$ 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | € 2 487 | £ 2 159 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 278 | \$ 300 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 258 460 | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 14 093 | € 12 813 | 61 | (3) | 58 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 664 | MXN 64 282 | 104 | 0 | 104 | 0,01 |
| | 01/2024 | 199 | ZAR 3 697 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | 3 898 | IDR 60 599 446 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | DKK 186 640 | € 25 043 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 85 075 | \$ 243 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR 3 085 708 | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 700 | € 1 545 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 4 388 | \$ 233 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 200 | IDR 3 086 499 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | 15 | KRW 19 554 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | KRW 129 970 | \$ 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 1 300 000 | € 8 274 | 0 | (112) | (112) | (0,01) |
| GLM | 01/2024 | DKK 36 454 | 4 891 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 2 939 | DKK 21 910 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 483 | £ 4 706 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 539 | ¥ 571 338 | 131 | 0 | 131 | 0,01 |
| | 01/2024 | 3 528 | \$ 3 810 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 26 100 | € 165 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 628 | MXN 10 978 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 2 850 | \$ 150 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 436 576 | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | € 1 183 | £ 1 025 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 65 | \$ 70 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 871 211 | 2 481 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 250 | IDR 3 846 750 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 100 | KRW 129 616 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 5 349 | BRL 26 234 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 1 074 | \$ 149 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 277 205 | 214 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | DKK 13 430 | € 1 802 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 4 843 | \$ 5 228 | 0 | (112) | (112) | (0,01) |
| | 03/2024 | ¥ 7 244 771 | € 44 868 | 0 | (1 973) | (1 973) | (0,12) |
| MYI | 01/2024 | € 1 134 | £ 978 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 969 | \$ 6 541 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 223 541 | € 203 400 | 1 084 | 0 | 1 084 | 0,06 |
| | 03/2024 | IDR 3 855 935 | \$ 251 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 250 | IDR 3 874 125 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 20 389 | \$ 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 02/2024 | ¥ 5 700 000 | € 36 183 | 0 | (585) | (585) | (0,03) |
| SCX | 01/2024 | CAD 23 712 | 15 891 | 0 | (386) | (386) | (0,02) |
| | 01/2024 | € 16 778 | ¥ 2 597 000 | 0 | (94) | (94) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 159 429 | € 183 631 | 4 | (322) | (318) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 1 989 | MXN 34 924 | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 284 903 | \$ 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 330 611 | 10 629 | 0 | (294) | (294) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 3 547 | INR 296 662 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| UAG | 01/2024 | DKK | 60 331 | € 8 108 | € 15 | € 0 | € 15 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 1 568 | £ 1 351 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 6 280 000 | € 40 223 | 0 | (182) | (182) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 298 | MXN 5 239 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | 5 560 000 | € 36 334 | 329 | 0 | 329 | 0,02 |
| | 03/2024 | \$ | 3 372 | INR 282 187 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | € 2 017 | € (4 955) | € (2 938) | (0,18) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| BPS | 01/2024 | € | 102 090 | CHF 97 379 | € 2 684 | € 0 | € 2 684 | 0,16 |
| BRC | 01/2024 | | 3 632 | 3 435 | 64 | 0 | 64 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | | 100 937 | 96 869 | 3 288 | 0 | 3 288 | 0,20 |
| DUB | 01/2024 | CHF | 35 | € 37 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | € | 107 252 | CHF 103 168 | 3 749 | 0 | 3 749 | 0,22 |
| MYI | 01/2024 | CHF | 15 | € 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | | 2 551 | 2 695 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 5 667 | CHF 5 341 | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| TOR | 01/2024 | CHF | 56 | € 60 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | € | 20 065 | CHF 19 075 | 459 | 0 | 459 | 0,03 |
| | | | | | € 10 323 | € (51) | € 10 272 | 0,62 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ 4 809 0,29

Total des Investissements

€ 1 829 040 109,41

Autres actifs et passifs à court terme

€ (157 327) (9,41)

Actifs nets

€ 1 671 713 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre à coupon zéro.
- (c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|-------------------------|---------|--------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG | 2,129 % | 24/11/2026 | 26/07/2023 - 03/08/2023 | € 5 519 | € 5 604 | 0,34 |

(i) Un titre d'une juste valeur globale de 1 087 € (31 décembre 2022 : 0 €) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(j) Un titre d'une juste valeur globale de 1 233 € (31 décembre 2022 : 4 360 €) et un montant en numéraire de 3 318 € (31 décembre 2022 : 5 628 €) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 34 315 € (31 décembre 2022 : 53 376 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|--------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 1 547 394 | € 233 | € 1 547 627 |
| Fonds d'investissement | 164 208 | 0 | 0 | 164 208 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 97 581 | 0 | 97 581 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 15 051 | 4 573 | 0 | 19 624 |
| Totaux | € 179 259 | € 1 649 548 | € 233 | € 1 829 040 |

Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques | | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|----------------|--|---|--------------------|
| | (Niveau 1) | (Niveau 1) | | | |
| Valeurs mobilières | € | 0 | € 1 747 790 | € 0 | € 1 747 790 |
| Fonds d'investissement | | 180 784 | 870 | 0 | 181 654 |
| Contrats de mise en pension | | 0 | 11 515 | 0 | 11 515 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | | (33 951) | 39 063 | 0 | 73 014 |
| Totaux | € | 146 833 | € 1 721 112 | € 0 | € 1 867 945 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 3,500 % | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (1 031) | € (1 041) | (0,06) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | € (1 041) | (0,06) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | € (431) | € 373 | € (58) | € (136) | € 0 | € (136) |
| BPS | 2 192 | (2 230) | (38) | (3 776) | 1 243 | (2 533) |
| BRC | (421) | 420 | (1) | (672) | 250 | (422) |
| CBK | 2 752 | (3 316) | (564) | (250) | 0 | (250) |
| DUB | (113) | 0 | (113) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 3 440 | (2 974) | 466 | (662) | 553 | (109) |
| GST | (600) | 624 | 24 | (1 966) | 1 883 | (83) |
| JPM | 1 | 0 | 1 | (3 086) | 3 064 | (22) |
| MBC | (2 085) | 2 046 | (39) | (236) | (390) | (626) |
| MYC | S/O | S/O | S/O | (26) | 70 | 44 |
| MYI | 1 032 | (2 110) | (1 078) | (46) | 37 | (9) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (30) | 0 | (30) |
| RYL | (555) | 390 | (165) | (198) | 30 | (168) |
| SCX | (1 029) | 698 | (331) | (313) | 373 | 60 |
| SSB | S/O | S/O | S/O | 2 746 | (1 770) | 976 |
| TOR | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 627 | (1 010) | (383) | (962) | (4 040) | (5 002) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 76,27 | 71,54 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 16,25 | 19,58 |
| Autres valeurs mobilières | 0,06 | 0,23 |
| Fonds d'investissement | 9,82 | 9,49 |
| Contrats de mise en pension | 5,84 | 0,60 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,53 | (1,69) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,35 | (1,62) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,29 | (0,50) |
| Contrats de prise en pension | (0,06) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 0,01 | 0,01 |
| Obligations et billets privés | 16,27 | 26,04 |
| Agences du gouvernement américain | 10,71 | 5,29 |
| Obligations du Trésor américain | 4,94 | 2,26 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 13,32 | 12,23 |
| Titres adossés à des actifs | 14,19 | 12,40 |
| Émissions souveraines | 23,09 | 20,18 |
| Titres privilégiés | 0,01 | 0,07 |
| Instruments à court terme | 10,04 | 12,87 |
| Fonds d'investissement | 9,82 | 9,49 |
| Contrats de mise en pension | 5,84 | 0,60 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,54 | (1,69) |
| Options vendues | | |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | (0,01) | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | S/O | (0,13) |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,35 | (1,49) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,51 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,15) | (1,04) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,18) | 0,07 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,62 | (0,04) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (9,41) | 2,37 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) € | JUSTE VALEUR (en milliers) € | EN % L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) \$ | JUSTE VALEUR (en milliers) € | EN % L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) € | JUSTE VALEUR (en milliers) € | EN % L'ACTIF NET |
|--|------------------------------------|---------------------------------|------------------|--|-------------------------------------|---------------------------------|------------------|--|------------------------------------|---------------------------------|------------------|
| Davidе Campari-Milano NV 1,250 % éch. 06/10/2027 | 1 100 | 1 006 | 0,19 | T-Mobile USA, Inc. 4,800 % éch. 15/07/2028 | 800 | 731 | 0,14 | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Deutsche Bahn Finance GmbH 4,000 % éch. 23/11/2043 | 700 | 766 | 0,14 | 5,750 % éch. 15/01/2054 | 500 | 479 | 0,09 | Canada Square Funding PLC 6,170 % éch. 17/06/2058 | 875 | 1 008 | 0,19 |
| DS Smith PLC 4,375 % éch. 27/07/2027 | 500 | 515 | 0,10 | Tapstry, Inc. 5,875 % éch. 27/11/2031 | 1 900 | 1 999 | 0,37 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 6,084 % éch. 25/08/2034 | 20 | 17 | 0,00 |
| ELO SACA 6,000 % éch. 22/03/2029 | 1 800 | 1 830 | 0,34 | Teleperformance SE 3,750 % éch. 24/11/2027 (c) | 1 300 | 1 299 | 0,24 | Domi BV 4,555 % éch. 15/06/2053 | 872 | 870 | 0,16 |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % éch. 31/03/2028 | 1 500 | 1 421 | 0,26 | TenneT Holding BV 4,750 % éch. 28/10/2042 | 1 100 | 1 282 | 0,24 | Dutch Property Finance BV 4,602 % éch. 28/07/2058 | 2 001 | 1 996 | 0,37 |
| General Electric Co. 4,125 % éch. 19/09/2035 | 1 100 | 1 182 | 0,22 | Tesco Corporate Treasury Services PLC 4,250 % éch. 27/02/2031 | 1 100 | 1 145 | 0,21 | 4,702 % éch. 28/10/2059 | 3 204 | 3 203 | 0,60 |
| Global Payments, Inc. 4,875 % éch. 17/03/2031 | 1 100 | 1 158 | 0,22 | Thames Water Utilities Finance PLC 1,250 % éch. 31/01/2032 | 1 800 | 1 360 | 0,25 | Great Hall Mortgages PLC 5,812 % éch. 18/06/2039 | 120 | 108 | 0,02 |
| GN Store Nord A/S 0,875 % éch. 25/11/2024 | 1 800 | 1 725 | 0,32 | 4,375 % éch. 18/01/2031 | 2 200 | 2 086 | 0,39 | Jubilee Place BV 4,835 % éch. 17/01/2059 | 2 105 | 2 107 | 0,39 |
| H Lundbeck A/S 0,875 % éch. 14/10/2027 | 2 100 | 1 905 | 0,35 | Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % éch. 24/11/2027 | 1 700 | 1 451 | 0,27 | 4,985 % éch. 17/10/2057 | 413 | 414 | 0,08 |
| Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,625 % éch. 18/09/2029 | 2 700 | 2 432 | 0,45 | Universal Music Group NV 3,750 % éch. 30/06/2032 | 1 600 | 1 651 | 0,31 | Landmark Mortgage Securities PLC 5,620 % éch. 17/04/2044 | 727 | 817 | 0,15 |
| 4,250 % éch. 18/03/2030 | 2 300 | 2 369 | 0,44 | 4,000 % éch. 13/06/2031 | 1 600 | 1 675 | 0,31 | Miravet SARL 4,806 % éch. 26/05/2065 | 1 742 | 1 728 | 0,32 |
| IMCD NV 2,125 % éch. 31/03/2027 | 100 | 96 | 0,02 | Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % éch. 26/03/2028 | 2 200 | 1 864 | 0,35 | Newgate Funding PLC 4,525 % éch. 15/12/2050 | 161 | 158 | 0,03 |
| 4,875 % éch. 18/09/2028 | 2 000 | 2 098 | 0,39 | Werfen S.A. 4,625 % éch. 06/06/2028 | 3 100 | 3 165 | 0,59 | Primrose Residential DAC 4,876 % éch. 24/10/2061 | 2 222 | 2 210 | 0,41 |
| InterContinental Hotels Group PLC 3,375 % éch. 08/10/2028 | 2 400 | 2 585 | 0,48 | Worldline S.A. 4,125 % éch. 12/09/2028 | 900 | 894 | 0,17 | RMAC Securities PLC 5,489 % éch. 12/06/2044 | 79 | 88 | 0,02 |
| International Distributions Services PLC 5,250 % éch. 14/09/2028 | 1 600 | 1 662 | 0,31 | Worley U.S. Finance Sub Ltd. 0,875 % éch. 09/06/2026 | 2 500 | 2 338 | 0,44 | Structured Asset Mortgage Investments Trust 6,170 % éch. 19/12/2034 | 49 | 39 | 0,01 |
| International Flavors & Fragrances, Inc. 1,800 % éch. 25/09/2026 | 850 | 809 | 0,15 | | | | | Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | 969 | 1 120 | 0,21 |
| ISS Global A/S 0,875 % éch. 18/06/2026 | 1 500 | 1 408 | 0,26 | | | | | Twin Bridges PLC 6,070 % éch. 12/03/2055 | 1 879 | 2 161 | 0,40 |
| JDE Peet's NV 0,500 % éch. 16/01/2029 | 3 850 | 3 342 | 0,62 | | | | | | | 18 044 | 3,36 |
| John Lewis PLC 4,250 % éch. 18/12/2034 | 1 050 | 882 | 0,16 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | | | | |
| 6,125 % éch. 21/01/2025 | 800 | 921 | 0,17 | Cadent Finance PLC 4,250 % éch. 05/07/2029 | 1 500 | 1 569 | 0,29 | Ares European CLO DAC 4,575 % éch. 15/04/2030 | 479 | 476 | 0,09 |
| Medtronic Global Holdings S.C.A. 1,500 % éch. 02/07/2039 | 1 700 | 1 302 | 0,24 | Électricité de France S.A. 4,250 % éch. 25/01/2032 | 2 700 | 2 837 | 0,53 | Aurium CLO DAC 4,966 % éch. 23/03/2032 | 1 300 | 1 290 | 0,24 |
| 2,250 % éch. 07/03/2039 | 2 000 | 1 710 | 0,32 | EnBW International Finance BV 4,000 % éch. 24/01/2035 | 1 000 | 1 035 | 0,19 | Bastille Euro CLO DAC 5,115 % éch. 15/01/2034 | 2 700 | 2 666 | 0,50 |
| Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % éch. 15/12/2030 | 101 | 111 | 0,02 | Enel Finance International NV 0,500 % éch. 17/06/2030 | 3 500 | 2 939 | 0,55 | BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 4,615 % éch. 15/07/2030 | 247 | 246 | 0,05 |
| 6,135 % éch. 15/12/2030 | 357 | 300 | 0,06 | EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031 | 2 400 | 1 863 | 0,35 | Bosphorus CLO DAC 4,960 % éch. 12/12/2032 | 1 900 | 1 877 | 0,35 |
| Molnlycke Holding AB 4,250 % éch. 08/09/2028 | 900 | 925 | 0,17 | Fluvius System Operator CVBA 3,875 % éch. 09/05/2033 | 1 100 | 1 139 | 0,21 | Cairn CLO DAC 4,666 % éch. 25/04/2032 | 597 | 591 | 0,11 |
| Mondelez International Holdings Netherlands BV 0,625 % éch. 09/09/2032 | 2 100 | 1 701 | 0,32 | Fortum Oyj 4,500 % éch. 26/05/2033 | 3 000 | 3 189 | 0,59 | Carlyle Euro CLO DAC 4,632 % éch. 15/08/2030 | 561 | 556 | 0,10 |
| Motability Operations Group PLC 3,500 % éch. 17/07/2031 | 2 000 | 2 054 | 0,38 | Koninklijke KPN NV 0,875 % éch. 14/12/2032 | 1 500 | 1 227 | 0,23 | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 4,925 % éch. 16/01/2033 | 1 600 | 1 575 | 0,29 |
| Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | 2 800 | 2 579 | 0,48 | National Grid North America, Inc. 4,151 % éch. 12/09/2027 | 1 700 | 1 748 | 0,32 | Contego CLO BV 4,735 % éch. 15/10/2030 | 698 | 692 | 0,13 |
| Netflix, Inc. 3,875 % éch. 15/11/2029 | 4 500 | 4 663 | 0,87 | National Grid PLC 3,875 % éch. 16/01/2029 | 1 600 | 1 646 | 0,31 | CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,782 % éch. 15/08/2032 | 992 | 983 | 0,18 |
| Pernod Ricard S.A. 3,750 % éch. 15/09/2033 | 900 | 939 | 0,17 | Orange S.A. 3,875 % éch. 11/09/2035 | 2 900 | 3 093 | 0,57 | 4,832 % éch. 17/06/2032 | 900 | 889 | 0,17 |
| Robert Bosch GmbH 4,375 % éch. 02/06/2043 | 1 400 | 1 506 | 0,28 | Orsted A/S 2,875 % éch. 14/06/2033 | 1 000 | 949 | 0,18 | Dryden Euro CLO DAC 4,815 % éch. 15/07/2031 | 671 | 668 | 0,12 |
| Sandoz Finance BV 4,220 % éch. 17/04/2030 | 1 600 | 1 663 | 0,31 | 4,125 % éch. 01/03/2035 | 300 | 313 | 0,06 | 4,862 % éch. 15/05/2034 | 200 | 197 | 0,04 |
| Sartorius Finance BV 4,500 % éch. 14/09/2032 | 800 | 836 | 0,16 | TDC Net A/S 5,618 % éch. 06/02/2030 | 3 100 | 3 204 | 0,60 | GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,893 % éch. 20/01/2032 | 100 | 99 | 0,02 |
| 4,875 % éch. 14/09/2035 | 1 100 | 1 163 | 0,22 | Verizon Communications, Inc. 4,750 % éch. 31/10/2034 | 3 600 | 4 000 | 0,74 | Harvest CLO DAC 4,815 % éch. 15/01/2032 | 200 | 197 | 0,04 |
| Siemens Energy Finance BV 4,250 % éch. 05/04/2029 | 1 100 | 1 076 | 0,20 | | | | | Invesco Euro CLO DAC 4,615 % éch. 15/07/2031 | 500 | 492 | 0,09 |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,625 % éch. 24/02/2043 | 2 600 | 2 712 | 0,50 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | Jubilee CLO DAC 4,565 % éch. 15/04/2030 | 917 | 909 | 0,17 |
| Silfin NV 2,875 % éch. 11/04/2027 | 900 | 845 | 0,16 | Ginnie Mae, TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | \$ 4 000 | 3 537 | 0,66 | Madison Park Euro Funding DAC 4,765 % éch. 15/07/2032 | 600 | 592 | 0,11 |
| Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % éch. 09/10/2025 (c) | 2 100 | 2 062 | 0,38 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % éch. 01/02/2054 | 1 300 | 1 042 | 0,19 | Man GLG Euro CLO DAC 4,775 % éch. 15/10/2032 | 2 674 | 2 641 | 0,49 |
| Suez SACA 2,375 % éch. 24/05/2030 | 1 700 | 1 605 | 0,30 | 4,000 % éch. 01/02/2054 | 3 400 | 2 914 | 0,54 | OCP Euro CLO DAC 4,785 % éch. 15/01/2032 | 278 | 276 | 0,05 |
| Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 4,375 % éch. 03/05/2033 | 600 | 633 | 0,12 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 8 200 | 7 348 | 1,37 | Palmer Square European Loan Funding DAC 4,685 % éch. 15/10/2031 | 2 390 | 2 352 | 0,44 |
| Syngenta Finance NV 4,892 % éch. 24/04/2025 | \$ 1 951 | 1 743 | 0,32 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 4 300 | 3 910 | 0,73 | 5,015 % éch. 15/10/2031 | 810 | 801 | 0,15 |
| | | | | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 5 300 | 4 872 | 0,91 | | | | |
| | | | | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 7 300 | 6 772 | 1,26 | | | | |
| | | | | | | 30 751 | 5,72 | | | | |
| | | | | Total Obligations et billets privés | | 403 300 | 75,08 | | | | |
| | | | | | | | | | | | |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050 % | 15/12/2031 | ¥ 1 860 000 | € (125) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2026 | \$ 27 600 | (464) | (0,09) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 16/06/2031 | 15 100 | (626) | (0,12) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2024 | 23 000 | 305 | 0,06 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2052 | 3 400 | (252) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/09/2025 | 37 000 | (199) | (0,04) |
| À payer | EURIBOR EUR à 3 mois | 0,500 | 09/02/2024 | € 52 200 | 148 | 0,03 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 8 000 | (900) | (0,17) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 30 650 | 1 635 | 0,31 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 35 500 | 1 094 | 0,20 |
| | | | | | € 616 | 0,11 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | € 724 | 0,13 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|---------------|
| BOA | 01/2024 | £ 130 | € 151 | € 1 | € 0 | € 1 | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | € 1 386 | \$ 1 513 | 0 | (16) | (16) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ 94 | € 109 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ 670 | € 611 | 4 | 0 | 4 | 0,00 | |
| BRC | 01/2024 | € 1 881 | \$ 2 057 | 0 | (19) | (19) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ 20 200 | € 129 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ 342 | € 314 | 4 | 0 | 4 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | € 2 035 | \$ 2 198 | 0 | (46) | (46) | (0,01) | |
| | 01/2024 | £ 978 | € 1 131 | 2 | 0 | 2 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ 58 | MXN 1 019 | 2 | 0 | 2 | 0,00 | |
| JPM | 03/2024 | CNH 452 | \$ 63 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | € 5 915 | € 6 467 | 0 | (61) | (61) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ 43 554 | € 39 609 | 193 | (3) | 190 | 0,03 | |
| MYI | 01/2024 | 582 | € 533 | 6 | 0 | 6 | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | £ 9 716 | 11 191 | 0 | (20) | (20) | 0,00 | |
| | | | | | € 213 | € (167) | € 46 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | | € 46 | 0,01 |
| Total des Investissements | | | | | | | € 561 118 | 104,46 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | | € (23 932) | (4,46) |
| Actifs nets | | | | | | | € 537 186 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Affilié au Fonds.

(c) Des titres d'une juste valeur globale de 8 413 € (31 décembre 2022 : 262 €) et un montant en numéraire de 0 € (31 décembre 2022 : 1 150 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 8 072 € (31 décembre 2022 : 25 216 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Tableau des investissements Fonds Euro Credit Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 536 476 | € 39 | € 536 515 |
| Fonds d'investissement | 9 501 | 0 | 0 | 9 501 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 14 437 | 0 | 14 437 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (104) | 769 | 0 | 665 |
| Totaux | € 9 397 | € 551 682 | € 39 | € 561 118 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 491 678 | € 0 | € 491 678 |
| Fonds d'investissement | 50 689 | 0 | 0 | 50 689 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 44 621 | 0 | 44 621 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (2 892) | (1 106) | 0 | (3 998) |
| Totaux | € 47 797 | € 535 193 | € 0 | € 582 990 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 1,000 % | 28/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (1 233) | € (1 241) | (0,23) |
| | 3,200 | 28/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (161) | (162) | (0,03) |
| JML | 2,000 | 14/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (872) | (874) | (0,16) |
| | 3,500 | 06/12/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (5 158) | (5 171) | (0,96) |
| MBC | 3,100 | 31/10/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (724) | (728) | (0,14) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | € (8 176) | (1,52) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | € 1 | € 0 | € 1 | € 60 | € 0 | € 60 |
| BPS | (11) | 0 | (11) | 40 | 0 | 40 |
| BRC | (16) | 0 | (16) | 15 | 0 | 15 |
| CBK | S/O | S/O | S/O | (4) | 0 | (4) |
| GLM | (42) | 0 | (42) | (1 545) | 1 412 | (133) |
| JPM | (1) | 0 | (1) | 26 | 0 | 26 |
| MBC | 129 | (300) | (171) | 2 095 | (1 900) | 195 |
| MYC | S/O | S/O | S/O | (5) | 0 | (5) |
| MYI | 6 | 0 | 6 | (139) | (50) | (189) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (30) | 0 | (30) |
| SCX | (20) | 0 | (20) | 18 | 0 | 18 |
| SSB | S/O | S/O | S/O | 292 | 0 | 292 |
| UAG | S/O | S/O | S/O | 11 | 0 | 11 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 90,72 | 72,82 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 9,16 | 7,71 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 0,07 |
| Fonds d'investissement | 1,77 | 8,31 |
| Contrats de mise en pension | 2,69 | 7,31 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,02) | (0,47) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,13 | (0,30) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,01 | 0,12 |
| Contrats de prise en pension | (1,52) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | S/O | 1,36 |
| Obligations et billets privés | 75,08 | 62,43 |
| Agences du gouvernement américain | 6,21 | 2,01 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 3,36 | 4,11 |
| Titres adossés à des actifs | 4,25 | 5,19 |
| Émissions souveraines | 10,98 | 0,03 |
| Instruments à court terme | S/O | 5,47 |
| Fonds d'investissement | 1,77 | 8,31 |
| Contrats de mise en pension | 2,69 | 7,31 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,02) | (0,47) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02 | (0,19) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,02 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,11 | (0,13) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | (0,24) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | 0,01 | 0,36 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (4,46) | 4,43 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | | | | | | |
| Charter Communications Operating LLC | | | | CTP NV | | | | 1,125 % éch. 22/06/2026 | € 3 700 | € 3 346 | 0,24 |
| 7,133 % éch. 01/02/2027 | \$ 2 507 | € 2 272 | 0,16 | 0,625 % éch. 27/09/2026 | € 1 600 | € 1 441 | 0,10 | 1,750 % éch. 24/11/2028 | 3 500 | 2 915 | 0,21 |
| SCUR-Alpha 1503 GmbH | | | | 1,250 % éch. 21/06/2029 | 7 000 | 5 812 | 0,42 | Société Générale S.A. | | | |
| 9,448 % éch. 29/03/2030 | € 1 200 | 1 102 | 0,08 | 1,500 % éch. 27/09/2031 | 1 500 | 1 172 | 0,09 | 2,797 % éch. 19/01/2028 | \$ 10 800 | 9 012 | 0,65 |
| 10,883 % éch. 29/03/2030 | \$ 2 481 | 2 073 | 0,15 | Deutsche Bank AG | | | | 6,446 % éch. 10/01/2029 | 7 700 | 7 217 | 0,52 |
| Sigma Bidco BV | | | | 1,375 % éch. 17/02/2032 | 700 | 576 | 0,04 | 6,691 % éch. 10/01/2034 | 300 | 287 | 0,02 |
| 7,413 % éch. 02/07/2025 | € 0 | 0 | 0,00 | 1,750 % éch. 19/11/2030 | 6 200 | 5 398 | 0,39 | Standard Chartered PLC | | | |
| Windstream Services LLC | | | | 2,129 % éch. 24/11/2026 (h) | \$ 2 800 | 2 377 | 0,17 | 6,750 % éch. 08/02/2028 | 8 500 | 7 932 | 0,57 |
| 11,706 % éch. 21/09/2027 | \$ 2 892 | 2 484 | 0,18 | 2,552 % éch. 07/01/2028 | 3 600 | 2 993 | 0,22 | Sunac China Holdings Ltd. | | | |
| Wm Morrison Supermarkets Ltd. | | | | 3,035 % éch. 28/05/2032 (h) | 200 | 151 | 0,01 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | 231 | 22 | 0,00 |
| 8,752 % éch. 04/11/2027 | € 4 500 | 4 286 | 0,31 | 3,547 % éch. 18/09/2031 | 1 100 | 874 | 0,06 | 6,250 % éch. 30/09/2027 | 231 | 17 | 0,00 |
| | | 12 217 | 0,88 | Digital Euro Finco LLC | | | | 6,500 % éch. 30/09/2027 | 462 | 33 | 0,00 |
| | | | | 1,125 % éch. 09/04/2028 | € 1 300 | 1 177 | 0,09 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | 693 | 29 | 0,00 |
| | | | | DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH | | | | 7,000 % éch. 30/09/2029 | 693 | 34 | 0,00 |
| | | | | 2,500 % éch. 25/01/2027 | 6 400 | 5 512 | 0,40 | 7,250 % éch. 30/09/2030 | 325 | 12 | 0,00 |
| | | | | EQT AB | | | | UBS Group AG | | | |
| | | | | 2,375 % éch. 06/04/2028 | 1 300 | 1 230 | 0,09 | 3,750 % éch. 26/03/2025 | 1 550 | 1 376 | 0,10 |
| | | | | G City Europe Ltd. | | | | 6,246 % éch. 22/09/2029 | 6 900 | 6 521 | 0,47 |
| | | | | 4,250 % éch. 11/09/2025 | 6 400 | 5 895 | 0,43 | 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 5 600 | 6 461 | 0,47 |
| | | | | Globalworth Real Estate Investments Ltd. | | | | UniCredit SpA | | | |
| | | | | 3,000 % éch. 29/03/2025 | 6 600 | 6 046 | 0,44 | 1,982 % éch. 03/06/2027 | \$ 500 | 414 | 0,03 |
| | | | | HSBC Holdings PLC | | | | 3,127 % éch. 03/06/2032 | 6 000 | 4 595 | 0,33 |
| | | | | 2,099 % éch. 04/06/2026 | \$ 600 | 517 | 0,04 | VICI Properties LP | | | |
| | | | | 3,973 % éch. 22/05/2030 | 1 800 | 1 523 | 0,11 | 3,875 % éch. 15/02/2029 | 300 | 250 | 0,02 |
| | | | | 5,402 % éch. 11/08/2033 | 12 000 | 10 916 | 0,79 | 4,500 % éch. 15/01/2028 | 300 | 259 | 0,02 |
| | | | | Hudson Pacific Properties LP | | | | Yango Justice International Ltd. | | | |
| | | | | 5,950 % éch. 15/02/2028 | 800 | 641 | 0,05 | 7,875 % éch. 04/09/2024 ^ | 12 600 | 63 | 0,00 |
| | | | | Intesa Sanpaolo SpA | | | | | | 332 913 | 24,00 |
| | | | | 8,248 % éch. 21/11/2033 | 14 275 | 14 034 | 1,01 | INDUSTRIE | | | |
| | | | | Jyske Realkredit A/S | | | | Altice Financing S.A. | | | |
| | | | | 0,500 % éch. 01/10/2043 DKK | 0 | 0 | 0,00 | 5,750 % éch. 15/08/2029 | 1 200 | 965 | 0,07 |
| | | | | 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | Altice France S.A. | | | |
| | | | | 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 | 3,375 % éch. 15/01/2028 | € 5 000 | 3 982 | 0,29 |
| | | | | 1,500 % éch. 01/10/2037 | 0 | 0 | 0,00 | Carvana Co. | | | |
| | | | | 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | 12,000 % éch. 01/12/2028 | \$ 786 | 576 | 0,04 |
| | | | | Kaisa Group Holdings Ltd. | | | | 13,000 % éch. 01/06/2030 | 2 266 | 1 639 | 0,12 |
| | | | | 10,875 % éch. 23/07/2023 ^ | \$ 5 400 | 159 | 0,01 | 14,000 % éch. 01/06/2031 | 3 147 | 2 303 | 0,17 |
| | | | | 11,500 % éch. 30/01/2023 ^ | 3 500 | 108 | 0,01 | DISH DBS Corp. | | | |
| | | | | 11,650 % éch. 01/06/2026 ^ | 4 000 | 122 | 0,01 | 5,250 % éch. 01/12/2026 | 473 | 368 | 0,03 |
| | | | | KBC Group NV | | | | Fortune Star BVI Ltd. | | | |
| | | | | 5,796 % éch. 19/01/2029 | 2 000 | 1 843 | 0,13 | 3,950 % éch. 02/10/2026 | € 10 100 | 6 456 | 0,46 |
| | | | | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. | | | | Las Vegas Sands Corp. | | | |
| | | | | 3,250 % éch. 12/11/2025 (i) | € 5 800 | 5 272 | 0,38 | 2,900 % éch. 25/06/2025 | \$ 1 600 | 1 393 | 0,10 |
| | | | | Lloyds Banking Group PLC | | | | Mitchells & Butlers Finance PLC | | | |
| | | | | 4,750 % éch. 21/09/2031 | 10 300 | 10 898 | 0,79 | 5,789 % éch. 15/12/2030 | £ 392 | 418 | 0,03 |
| | | | | Logicor Financing SARL | | | | 6,135 % éch. 15/12/2030 | \$ 678 | 570 | 0,04 |
| | | | | 1,500 % éch. 13/07/2026 | 2 600 | 2 439 | 0,18 | Nissan Motor Co. Ltd. | | | |
| | | | | 1,625 % éch. 17/01/2030 | 3 600 | 3 087 | 0,22 | 4,345 % éch. 17/09/2027 | 1 200 | 1 040 | 0,07 |
| | | | | Nationwide Building Society | | | | Q-Park Holding BV | | | |
| | | | | 4,500 % éch. 01/11/2026 | 4 100 | 4 231 | 0,31 | 3,500 % éch. 01/02/2025 | € 7 800 | 7 548 | 0,54 |
| | | | | 6,557 % éch. 18/10/2027 | \$ 9 100 | 8 533 | 0,62 | Roadster Finance DAC | | | |
| | | | | NatWest Group PLC | | | | 1,625 % éch. 09/12/2029 | 200 | 194 | 0,01 |
| | | | | 6,016 % éch. 02/03/2034 | 12 200 | 11 607 | 0,84 | 2,375 % éch. 08/12/2032 | 400 | 353 | 0,03 |
| | | | | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab | | | | Sandoz Finance BV | | | |
| | | | | 0,500 % éch. 01/10/2043 DKK | 0 | 0 | 0,00 | 4,220 % éch. 17/04/2030 | 3 500 | 3 638 | 0,26 |
| | | | | 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | Syngenta Finance NV | | | |
| | | | | 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 | 4,892 % éch. 24/04/2025 | \$ 4 864 | 4 346 | 0,31 |
| | | | | 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | Ubisoft Entertainment S.A. | | | |
| | | | | Nykredit Realkredit A/S | | | | 0,878 % éch. 24/11/2027 (i) | € 8 600 | 7 341 | 0,53 |
| | | | | 0,500 % éch. 01/10/2043 | 0 | 0 | 0,00 | United Airlines Pass-Through Trust | | | |
| | | | | 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | 5,875 % éch. 15/04/2029 | \$ 259 | 237 | 0,02 |
| | | | | 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 | Venture Global LNG, Inc. | | | |
| | | | | 1,500 % éch. 01/10/2037 | 0 | 0 | 0,00 | 9,500 % éch. 01/02/2029 | 4 875 | 4 673 | 0,34 |
| | | | | 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | 9,875 % éch. 01/02/2032 | 1 625 | 1 533 | 0,11 |
| | | | | 2,500 % éch. 01/10/2036 | 0 | 0 | 0,00 | Windstream Escrow LLC | | | |
| | | | | Realkredit Danmark A/S | | | | 7,750 % éch. 15/08/2028 | 1 800 | 1 429 | 0,10 |
| | | | | 2,500 % éch. 01/04/2036 | 0 | 0 | 0,00 | | | 51 002 | 3,67 |
| | | | | Sagax AB | | | | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | |
| | | | | 1,125 % éch. 30/01/2027 | € 7 082 | 6 383 | 0,46 | Pacific Gas & Electric Co. | | | |
| | | | | 2,000 % éch. 17/01/2024 | 332 | 332 | 0,02 | 3,150 % éch. 01/01/2026 | 1 000 | 869 | 0,06 |
| | | | | 2,250 % éch. 13/03/2025 | 5 100 | 4 966 | 0,36 | 3,300 % éch. 01/12/2027 | 3 275 | 2 770 | 0,20 |
| | | | | Sagax Euro MTN NL BV | | | | 6,100 % éch. 15/01/2029 | 6 800 | 6 376 | 0,46 |
| | | | | 0,750 % éch. 26/01/2028 (i) | 1 400 | 1 198 | 0,09 | 6,400 % éch. 15/06/2033 | 5 000 | 4 767 | 0,35 |
| | | | | 1,000 % éch. 17/05/2029 | 1 700 | 1 392 | 0,10 | | | | |
| | | | | Santander UK Group Holdings PLC | | | | | | | |
| | | | | 2,896 % éch. 15/03/2032 | \$ 13 185 | 10 201 | 0,74 | | | | |
| | | | | Sirius Real Estate Ltd. | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 6,950 % éch. 15/03/2034 | \$ 9 500 | € 9 457 | 0,68 | Bear Stearns Mortgage Funding Trust | \$ 2 | € 2 | 0,00 | Dutch Property Finance BV | € 6 409 | € 6 406 | 0,46 |
| | | 24 239 | 1,75 | 7,500 % éch. 25/08/2036 | | | | 4,702 % éch. 28/10/2059 | € 15 359 | € 15 401 | 1,11 |
| Total Obligations et billets privés | | 408 154 | 29,42 | Bridgegate Funding PLC | £ 24 122 | 27 996 | 2,02 | 4,852 % éch. 28/04/2064 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES | | | | BX Trust | | | | EuroMASTR PLC | | | |
| Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) | | | | 7,429 % éch. 15/05/2030 | \$ 1 015 | 907 | 0,07 | 5,531 % éch. 15/06/2040 | £ 115 | 125 | 0,01 |
| 8,000 % éch. 31/12/2026 (b) | € 1 685 | 883 | 0,07 | 8,844 % éch. 15/07/2034 | 895 | 810 | 0,06 | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust | \$ 141 | 67 | 0,01 |
| Sunac China Holdings Ltd. | | | | 9,944 % éch. 15/07/2034 | 3 400 | 3 041 | 0,22 | 6,143 % éch. 25/04/2036 | 46 | 35 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 30/09/2032 | \$ 398 | 28 | 0,00 | Chase Mortgage Finance Trust | | | | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust | | | |
| | | 911 | 0,07 | 3,847 % éch. 25/03/2037 | 21 | 18 | 0,00 | 5,673 % éch. 25/11/2037 | 17 | 12 | 0,00 |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | 4,501 % éch. 25/01/2036 | 178 | 144 | 0,01 | Glenbeigh Issuer DAC | € 11 384 | 11 376 | 0,82 |
| Ginnie Mae, TBA | | | | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 96 | 40 | 0,00 | 4,916 % éch. 24/03/2046 | € 4 630 | 4 620 | 0,33 |
| 5,000 % éch. 01/01/2054 | 3 100 | 2 787 | 0,20 | ChaseFlex Trust | 71 | 21 | 0,00 | GSC Capital Corp. Mortgage Trust | \$ 59 | 50 | 0,00 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | | ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | GSR Mortgage Loan Trust | | | |
| 3,000 % éch. 01/05/2052 | 1 255 | 1 005 | 0,07 | 4,204 % éch. 25/08/2037 | 22 | 15 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/06/2035 | 95 | 85 | 0,01 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | HarborView Mortgage Loan Trust | | | |
| 3,000 % éch. 01/03/2054 | 19 300 | 15 493 | 1,12 | 3,840 % éch. 25/03/2037 | 34 | 27 | 0,00 | 4,041 % éch. 19/06/2036 | 90 | 42 | 0,00 |
| 4,000 % éch. 01/02/2054 | 1 800 | 1 543 | 0,11 | 4,752 % éch. 25/04/2037 | 119 | 92 | 0,01 | 4,672 % éch. 19/12/2035 | 172 | 81 | 0,01 |
| 5,000 % éch. 01/01/2054 | 155 300 | 139 106 | 10,03 | 5,500 % éch. 25/12/2035 | 109 | 53 | 0,00 | 5,927 % éch. 19/12/2035 | 14 | 12 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 01/01/2054 | 216 400 | 196 761 | 14,18 | 5,800 % éch. 25/12/2034 | 4 | 3 | 0,00 | Harbour Energy PLC | | | |
| 6,000 % éch. 01/02/2054 | 268 100 | 246 445 | 17,77 | 6,250 % éch. 25/11/2037 | 139 | 58 | 0,01 | 6,120 % éch. 28/01/2054 | £ 5 700 | 6 534 | 0,47 |
| 6,500 % éch. 01/02/2054 | 55 400 | 51 392 | 3,70 | CitiMortgage Alternative Loan Trust | | | | Hops Hill PLC | | | |
| | | 654 532 | 47,18 | 6,000 % éch. 25/01/2037 | 206 | 164 | 0,01 | 6,148 % éch. 27/05/2054 | 831 | 959 | 0,07 |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | 6,000 % éch. 25/06/2037 | 344 | 272 | 0,02 | HSI Asset Loan Obligation Trust | | | |
| Obligations du Trésor américain | | | | Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust | | | | 6,000 % éch. 25/06/2037 | \$ 70 | 54 | 0,00 |
| 4,375 % éch. 15/08/2043 | 5 300 | 4 899 | 0,35 | 4,080 % éch. 25/08/2037 | 55 | 24 | 0,00 | Impac Secured Assets Trust | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (f) | | | | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 49 | 22 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/11/2036 | 12 | 11 | 0,00 |
| 1,375 % éch. 15/07/2033 | 9 320 | 8 186 | 0,59 | Countrywide Alternative Loan Trust | | | | IndyMac Mortgage Loan Trust | | | |
| 1,500 % éch. 15/02/2053 | 3 519 | 2 892 | 0,21 | 3,879 % éch. 25/05/2036 | 10 | 7 | 0,00 | 3,355 % éch. 25/06/2036 | 39 | 29 | 0,00 |
| | | 15 977 | 1,15 | 4,120 % éch. 25/06/2037 | 41 | 34 | 0,00 | 3,751 % éch. 25/11/2035 | 79 | 66 | 0,01 |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | 5,237 % éch. 25/09/2034 | 3 | 3 | 0,00 | 3,940 % éch. 25/06/2037 | 1 044 | 563 | 0,04 |
| Alba PLC | | | | 5,500 % éch. 25/03/2035 | 5 019 | 4 003 | 0,29 | 5,720 % éch. 25/09/2037 | 3 672 | 3 349 | 0,24 |
| 5,599 % éch. 15/12/2038 | £ 1 407 | 1 499 | 0,11 | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 71 | 39 | 0,00 | 6,090 % éch. 25/10/2036 | 10 157 | 4 469 | 0,32 |
| American Home Mortgage Assets Trust | | | | 5,500 % éch. 25/12/2035 | 62 | 31 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/01/2035 | 46 | 29 | 0,00 |
| 5,680 % éch. 25/12/2046 | \$ 1 308 | 980 | 0,07 | 5,500 % éch. 25/02/2036 | 45 | 24 | 0,00 | 6,250 % éch. 25/11/2037 | 42 | 17 | 0,00 |
| 5,932 % éch. 25/11/2046 | 443 | 113 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/04/2047 | 96 | 48 | 0,00 | JPMorgan Alternative Loan Trust | | | |
| Atlas Funding PLC | | | | 6,000 % éch. 25/03/2036 | 198 | 81 | 0,01 | 4,531 % éch. 25/12/2036 | 4 | 3 | 0,00 |
| 6,120 % éch. 25/07/2058 | £ 673 | 778 | 0,06 | 6,000 % éch. 25/05/2036 | 1 133 | 526 | 0,04 | 5,950 % éch. 25/10/2036 | 2 700 | 2 173 | 0,16 |
| Atrium Hotel Portfolio Trust | | | | 6,000 % éch. 25/08/2036 | 234 | 125 | 0,01 | 5,957 % éch. 27/06/2037 | 161 | 101 | 0,01 |
| 7,309 % éch. 15/06/2035 | \$ 9 700 | 8 527 | 0,62 | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 58 | 30 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/03/2036 | 182 | 95 | 0,01 |
| Avon Finance PLC | | | | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 782 | 331 | 0,02 | 6,550 % éch. 25/05/2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % éch. 28/12/2049 | £ 8 300 | 9 558 | 0,69 | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 313 | 149 | 0,01 | Jubilee Place BV | | | |
| Banc of America Alternative Loan Trust | | | | 6,250 % éch. 25/07/2036 | 1 309 | 544 | 0,04 | 4,835 % éch. 17/01/2059 | € 5 304 | 5 309 | 0,38 |
| 1,170 % éch. 25/06/2037 (a) | \$ 225 | 19 | 0,00 | 6,250 % éch. 25/12/2036 | 20 | 8 | 0,00 | 4,985 % éch. 17/10/2057 | 1 115 | 1 118 | 0,08 |
| 5,500 % éch. 25/10/2033 | 162 | 142 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/12/2036 | 59 | 24 | 0,00 | Jupiter Mortgage PLC | | | |
| 5,830 % éch. 25/06/2037 | 207 | 140 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/08/2037 | 340 | 131 | 0,01 | 6,621 % éch. 20/07/2060 | £ 26 960 | 31 109 | 2,24 |
| 6,000 % éch. 25/07/2046 | 206 | 158 | 0,01 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 7,721 % éch. 20/07/2060 | 8 760 | 10 093 | 0,73 |
| Banc of America Funding Trust | | | | 5,950 % éch. 25/04/2036 | 143 | 113 | 0,01 | Lavender Trust | | | |
| 4,503 % éch. 20/09/2046 | 32 | 25 | 0,00 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | 6,250 % éch. 26/10/2036 | \$ 162 | 73 | 0,01 |
| 4,732 % éch. 20/04/2035 | 52 | 42 | 0,00 | 4,008 % éch. 25/01/2036 | 24 | 20 | 0,00 | Lehman Mortgage Trust | | | |
| 5,652 % éch. 20/09/2046 | 24 | 21 | 0,00 | 4,110 % éch. 20/02/2036 | 122 | 97 | 0,01 | 4,505 % éch. 25/12/2035 | 159 | 26 | 0,00 |
| 5,852 % éch. 20/10/2036 | 66 | 45 | 0,00 | 4,294 % éch. 25/11/2037 | 77 | 62 | 0,01 | 5,032 % éch. 25/01/2036 | 45 | 37 | 0,00 |
| 5,890 % éch. 25/04/2037 | 59 | 44 | 0,00 | 4,430 % éch. 25/09/2047 | 63 | 50 | 0,00 | Lehman XS Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/08/2037 | 245 | 175 | 0,01 | 4,543 % éch. 20/12/2035 | 52 | 40 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/12/2036 | 678 | 588 | 0,04 |
| 6,245 % éch. 20/11/2035 | 70 | 57 | 0,01 | 4,970 % éch. 20/09/2036 | 23 | 18 | 0,00 | Ludgate Funding PLC | | | |
| Banc of America Mortgage Trust | | | | 5,750 % éch. 25/12/2035 | 65 | 29 | 0,00 | 4,115 % éch. 01/01/2061 | € 5 039 | 4 850 | 0,35 |
| 6,000 % éch. 25/10/2036 | 9 | 6 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/03/2037 | 92 | 36 | 0,00 | 4,155 % éch. 01/12/2060 | 3 065 | 2 949 | 0,21 |
| BCAP LLC Trust | | | | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 14 | 6 | 0,00 | Mansard Mortgages PLC | | | |
| 3,840 % éch. 26/03/2037 | 50 | 36 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/07/2037 | 161 | 63 | 0,01 | 5,989 % éch. 15/12/2049 | £ 839 | 955 | 0,07 |
| 4,502 % éch. 27/03/2037 | 221 | 164 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/03/2035 | 262 | 155 | 0,01 | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust | | | |
| 5,500 % éch. 25/11/2034 | 11 | 9 | 0,00 | 6,090 % éch. 25/03/2035 | 14 | 11 | 0,00 | 3,989 % éch. 25/03/2035 | \$ 11 | 9 | 0,00 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | | | | 6,210 % éch. 25/02/2035 | 173 | 133 | 0,01 | Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust | | | |
| 4,761 % éch. 25/02/2035 | 5 | 4 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/11/2036 | 255 | 79 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 124 | 87 | 0,01 |
| 5,478 % éch. 25/08/2035 | 4 | 4 | 0,00 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | |
| 8,065 % éch. 25/12/2046 | 152 | 113 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/01/2036 | 160 | 90 | 0,01 | 3,853 % éch. 25/03/2036 | 263 | 129 | 0,01 |
| Bear Stearns ALT-A Trust | | | | 6,620 % éch. 25/09/2034 | 21 | 26 | 0,00 | Miravet SARL | | | |
| 3,971 % éch. 25/05/2036 | 293 | 130 | 0,01 | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust | | | | 4,806 % éch. 26/05/2065 | € 4 903 | 4 864 | 0,35 |
| 4,196 % éch. 25/11/2036 | 63 | 25 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/08/2036 | 1 190 | 331 | 0,02 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | |
| 4,454 % éch. 25/09/2035 | 146 | 51 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/07/2036 | 180 | 80 | 0,01 | 4,768 % éch. 25/03/2036 | \$ 99 | 55 | 0,01 |
| 5,238 % éch. 25/07/2035 | 305 | 193 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/10/2021 | 202 | 12 | 0,00 | 5,962 % éch. 25/06/2036 | 4 303 | 1 130 | 0,08 |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | | 6,500 % éch. 25/02/2022 | 513 | 56 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/10/2037 | 112 | 55 | 0,01 |
| 5,750 % éch. 25/11/2034 | 160 | 125 | 0,01 | Credit Suisse Mortgage Capital Trust | | | | 6,201 % éch. 25/02/2047 | 2 931 | 962 | 0,07 |
| | | | | 7,344 % éch. 25/07/2032 | 1 024 | 853 | 0,06 | Mortimer BTL PLC | | | |
| | | | | Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust | | | | 0,000 % éch. 22/12/2056 | £ 5 800 | 6 710 | 0,48 |
| | | | | 5,770 % éch. 25/04/2037 | 176 | 108 | 0,01 | | | | |
| | | | | Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates | | | | | | | |
| | | | | 4,042 % éch. 27/06/2037 | 2 861 | 2 232 | 0,16 | | | | |

Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Newgate Funding PLC | | | | ALME Loan Funding DAC | | | | First NLC Trust | | | |
| 4,525 % éch. 15/12/2050 | € 179 | € 176 | 0,01 | 4,715 % éch. 15/01/2032 | € 291 | € 288 | 0,02 | 5,610 % éch. 25/08/2037 | \$ 137 | € 62 | 0,00 |
| 5,584 % éch. 01/12/2050 | £ 1 013 | 1 142 | 0,08 | Ameriset Mortgage Securities Trust | | | | 5,750 % éch. 25/08/2037 | 46 | 21 | 0,00 |
| 6,340 % éch. 15/12/2050 | 142 | 158 | 0,01 | 5,710 % éch. 25/10/2036 | \$ 3 098 | 826 | 0,06 | Fremont Home Loan Trust | | | |
| Nomura Resecuritization Trust | | | | Ameriset Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 5,590 % éch. 25/01/2037 | 10 169 | 4 184 | 0,30 |
| 6,370 % éch. 25/03/2037 | \$ 3 426 | 2 971 | 0,22 | 3,793 % éch. 25/04/2034 | 1 412 | 1 229 | 0,09 | 5,620 % éch. 25/01/2037 | 209 | 86 | 0,01 |
| Primrose Residential DAC | | | | 6,190 % éch. 25/07/2035 | 316 | 279 | 0,02 | 5,790 % éch. 25/08/2036 | 181 | 53 | 0,00 |
| 4,876 % éch. 24/10/2061 | € 4 286 | 4 262 | 0,31 | Aqueduct European CLO DAC | | | | 5,810 % éch. 25/02/2037 | 635 | 193 | 0,01 |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust | | | | 4,625 % éch. 20/07/2030 | € 2 287 | 2 270 | 0,16 | 6,340 % éch. 25/11/2034 | 1 266 | 1 009 | 0,07 |
| 5,890 % éch. 25/06/2037 | \$ 45 | 36 | 0,00 | 4,932 % éch. 15/08/2034 | 1 000 | 985 | 0,07 | 6,400 % éch. 25/04/2035 | 3 025 | 2 615 | 0,19 |
| 6,000 % éch. 25/06/2036 | 54 | 38 | 0,00 | Ares European CLO DAC | | | | Golden Bar Securitisation SRL | | | |
| 6,000 % éch. 25/05/2037 | 44 | 31 | 0,00 | 4,625 % éch. 15/10/2030 | 665 | 660 | 0,05 | 6,816 % éch. 22/09/2043 | € 1 700 | 1 723 | 0,12 |
| 6,250 % éch. 25/02/2037 | 117 | 82 | 0,01 | 4,843 % éch. 20/04/2032 | 2 100 | 2 067 | 0,15 | Griffith Park CLO DAC | | | |
| Residential Asset Securitization Trust | | | | 5,122 % éch. 21/01/2033 | 8 500 | 8 414 | 0,61 | 4,704 % éch. 21/11/2031 | 3 286 | 3 234 | 0,23 |
| 6,000 % éch. 25/02/2036 | 322 | 123 | 0,01 | Argent Securities Trust | | | | GSAA Home Equity Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/06/2036 | 145 | 56 | 0,01 | 5,620 % éch. 25/09/2036 | \$ 844 | 246 | 0,02 | 5,772 % éch. 25/11/2036 | \$ 123 | 33 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/11/2036 | 121 | 40 | 0,00 | 5,670 % éch. 25/06/2036 | 455 | 109 | 0,01 | GSAMP Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/03/2037 | 97 | 29 | 0,00 | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 5,570 % éch. 25/12/2046 | 181 | 81 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/05/2037 | 631 | 298 | 0,02 | 6,110 % éch. 25/01/2036 | 465 | 373 | 0,03 | 5,610 % éch. 25/12/2036 | 832 | 396 | 0,03 |
| 6,250 % éch. 25/11/2036 | 83 | 28 | 0,00 | Asset-Backed Funding Certificates Trust | | | | 5,620 % éch. 25/12/2046 | 498 | 224 | 0,02 |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust | | | | 6,470 % éch. 25/06/2037 | 70 | 49 | 0,00 | 5,670 % éch. 25/11/2036 | 187 | 80 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/10/2036 | 48 | 33 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/03/2034 | 111 | 96 | 0,01 | 5,700 % éch. 25/12/2046 | 91 | 41 | 0,00 |
| RMAC PLC | | | | Aurium CLO DAC | | | | 5,770 % éch. 25/09/2036 | 701 | 226 | 0,02 |
| 0,000 % éch. 15/02/2047 | £ 11 100 | 12 851 | 0,93 | 4,635 % éch. 16/04/2030 | € 2 080 | 2 057 | 0,15 | Harvest CLO DAC | | | |
| RMAC Securities PLC | | | | 4,635 % éch. 16/04/2030 | € 2 080 | 2 057 | 0,15 | 4,605 % éch. 15/10/2031 | € 1 368 | 1 345 | 0,10 |
| 4,220 % éch. 12/06/2044 | € 3 651 | 3 458 | 0,25 | Bain Capital Euro CLO DAC | | | | 4,695 % éch. 15/01/2031 | 782 | 776 | 0,06 |
| 5,509 % éch. 12/06/2044 | £ 381 | 424 | 0,03 | 5,102 % éch. 24/01/2033 | 400 | 397 | 0,03 | 4,872 % éch. 18/11/2030 | 2 048 | 2 030 | 0,15 |
| 5,609 % éch. 12/06/2044 | 3 775 | 4 157 | 0,30 | Bastille Euro CLO DAC | | | | 4,943 % éch. 20/10/2032 | 2 000 | 1 980 | 0,14 |
| Shamrock Residential DAC | | | | 5,115 % éch. 15/01/2034 | 8 200 | 8 097 | 0,58 | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | |
| 4,726 % éch. 24/01/2061 | € 7 579 | 7 554 | 0,55 | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | | 5,690 % éch. 25/12/2036 | \$ 196 | 47 | 0,00 |
| 4,876 % éch. 24/06/2071 | 13 919 | 13 853 | 1,00 | 4,812 % éch. 25/10/2036 | \$ 33 | 14 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/12/2036 | 940 | 224 | 0,02 |
| Southern Pacific Securities PLC | | | | 6,370 % éch. 25/08/2034 | 1 033 | 904 | 0,07 | 5,845 % éch. 25/05/2037 | 4 600 | 4 020 | 0,29 |
| 4,499 % éch. 10/03/2044 | 2 167 | 2 131 | 0,15 | Blackrock European CLO DAC | | | | 5,910 % éch. 25/12/2036 | 544 | 131 | 0,01 |
| Stratton Mortgage Funding PLC | | | | 4,825 % éch. 15/12/2032 | € 600 | 593 | 0,04 | JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. | | | |
| 7,721 % éch. 20/07/2060 | £ 5 594 | 6 452 | 0,47 | BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | | 6,400 % éch. 25/06/2035 | 4 968 | 4 069 | 0,29 |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | | 4,615 % éch. 15/07/2030 | 1 777 | 1 768 | 0,13 | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | |
| 4,669 % éch. 25/02/2036 | \$ 51 | 37 | 0,00 | 4,875 % éch. 15/01/2033 | 2 300 | 2 266 | 0,16 | 6,337 % éch. 25/08/2036 | 88 | 45 | 0,00 |
| 5,906 % éch. 25/10/2035 | 109 | 87 | 0,01 | BNPP AM Euro CLO DAC | | | | Jubilee CLO DAC | | | |
| SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | | 4,615 % éch. 15/10/2031 | 1 133 | 1 118 | 0,08 | 4,575 % éch. 15/04/2030 | € 661 | 657 | 0,05 |
| 5,068 % éch. 25/02/2037 | 72 | 56 | 0,01 | BNPP IP Euro CLO DAC | | | | Lehman XS Trust | | | |
| TBW Mortgage-Backed Trust | | | | 4,755 % éch. 15/10/2030 | 961 | 952 | 0,07 | 5,640 % éch. 25/02/2037 | \$ 904 | 620 | 0,04 |
| 6,300 % éch. 25/03/2037 | 8 300 | 1 650 | 0,12 | Bosphorus CLO DAC | | | | Mackay Shields Euro CLO DAC | | | |
| Tower Bridge Funding PLC | | | | 4,745 % éch. 15/12/2030 | 596 | 591 | 0,04 | 4,923 % éch. 20/10/2032 | € 1 300 | 1 286 | 0,09 |
| 6,721 % éch. 20/10/2064 | £ 10 108 | 11 735 | 0,85 | Cairn CLO DAC | | | | Man GLG Euro CLO DAC | | | |
| 8,371 % éch. 20/10/2064 | 2 300 | 2 678 | 0,19 | 4,618 % éch. 31/01/2030 | 4 139 | 4 102 | 0,30 | 4,645 % éch. 15/10/2030 | 357 | 355 | 0,03 |
| Twin Bridges PLC | | | | Carlyle Euro CLO DAC | | | | 4,835 % éch. 15/01/2030 | 1 836 | 1 835 | 0,13 |
| 6,432 % éch. 15/05/2056 | 9 100 | 10 524 | 0,76 | 4,632 % éch. 15/08/2030 | 5 128 | 5 081 | 0,37 | Marlay Park CLO DAC | | | |
| UBS Commercial Mortgage Trust | | | | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC | | | | 4,705 % éch. 15/10/2030 | 1 141 | 1 133 | 0,08 |
| 6,909 % éch. 15/02/2032 | \$ 7 520 | 6 751 | 0,49 | 4,715 % éch. 15/07/2030 | 1 050 | 1 044 | 0,08 | MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | |
| Uropa Securities PLC | | | | Carrington Mortgage Loan Trust | | | | 5,570 % éch. 25/11/2036 | \$ 133 | 39 | 0,00 |
| 4,333 % éch. 10/10/2040 | € 1 612 | 1 478 | 0,11 | 5,730 % éch. 25/02/2037 | \$ 136 | 114 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/08/2036 | 231 | 81 | 0,01 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | Centex Home Equity Loan Trust | | | | 5,950 % éch. 25/06/2036 | 125 | 41 | 0,00 |
| 3,847 % éch. 25/05/2037 | \$ 37 | 29 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/10/2035 | 4 024 | 3 561 | 0,26 | 5,950 % éch. 25/08/2036 | 139 | 48 | 0,00 |
| 3,972 % éch. 25/10/2036 | 27 | 21 | 0,00 | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | |
| 4,063 % éch. 25/12/2036 | 224 | 173 | 0,01 | 6,851 % éch. 25/05/2036 | 126 | 44 | 0,00 | 4,471 % éch. 25/11/2037 | 599 | 189 | 0,01 |
| 4,727 % éch. 25/12/2035 | 6 | 5 | 0,00 | Contego CLO BV | | | | 6,010 % éch. 25/04/2047 | 1 504 | 555 | 0,04 |
| 6,250 % éch. 25/10/2044 | 54 | 46 | 0,00 | 4,735 % éch. 15/10/2030 | € 1 297 | 1 286 | 0,09 | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | Contego CLO DAC | | | | 5,580 % éch. 25/02/2037 | 473 | 139 | 0,01 |
| 5,782 % éch. 25/04/2047 | 342 | 240 | 0,02 | 4,642 % éch. 23/01/2030 | 5 531 | 5 453 | 0,39 | 5,600 % éch. 25/01/2037 | 96 | 39 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/07/2036 | 92 | 56 | 0,00 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 5,610 % éch. 25/10/2036 | 105 | 41 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/06/2037 | 24 | 20 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/12/2046 | \$ 3 057 | 2 587 | 0,19 | 5,650 % éch. 25/03/2037 | 316 | 123 | 0,01 |
| Wells Fargo Alternative Loan Trust | | | | 6,010 % éch. 25/03/2036 | 979 | 773 | 0,06 | 5,670 % éch. 25/09/2036 | 55 | 18 | 0,00 |
| 6,250 % éch. 25/11/2037 | 28 | 22 | 0,00 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust | | | | 5,670 % éch. 25/02/2037 | 106 | 46 | 0,00 |
| | | 291 596 | 21,02 | 3,201 % éch. 25/01/2037 | 2 060 | 581 | 0,04 | 5,720 % éch. 25/03/2037 | 316 | 123 | 0,01 |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | | 5,770 % éch. 25/09/2036 | 325 | 104 | 0,01 |
| Accunia European CLO DAC | | | | 4,652 % éch. 21/07/2030 | € 10 300 | 10 184 | 0,73 | 6,445 % éch. 25/02/2035 | 2 379 | 1 600 | 0,12 |
| 4,915 % éch. 15/07/2030 | € 487 | 486 | 0,04 | 4,782 % éch. 15/08/2032 | 198 | 197 | 0,01 | 6,520 % éch. 25/06/2033 | 3 | 2 | 0,00 |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | 4,832 % éch. 17/06/2032 | 1 300 | 1 284 | 0,09 | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | |
| 5,690 % éch. 25/10/2036 | \$ 1 854 | 621 | 0,05 | 4,852 % éch. 26/08/2032 | 500 | 494 | 0,04 | 5,640 % éch. 25/04/2037 | 252 | 119 | 0,01 |
| 5,690 % éch. 25/12/2036 | 408 | 97 | 0,01 | Dryden Euro CLO DAC | | | | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,750 % éch. 25/07/2036 | 100 | 70 | 0,01 | 4,752 % éch. 15/05/2032 | 576 | 568 | 0,04 | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 2 266 | 740 | 0,05 |
| 5,750 % éch. 25/02/2037 | 2 756 | 1 055 | 0,08 | 4,862 % éch. 15/05/2034 | 299 | 295 | 0,02 | 6,010 % éch. 25/04/2037 | 2 266 | 740 | 0,05 |
| 5,770 % éch. 25/01/2037 | 6 819 | 3 325 | 0,24 | Fieldstone Mortgage Investment Trust | | | | 6,465 % éch. 25/09/2046 | 284 | 86 | 0,01 |
| 6,445 % éch. 25/11/2033 | 685 | 605 | 0,04 | 6,250 % éch. 25/12/2035 | \$ 9 291 | 7 319 | 0,53 | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | | | |
| | | | | | | | | 6,532 % éch. 25/10/2036 | 153 | 32 | 0,00 |
| | | | | | | | | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | |
| | | | | | | | | 5,770 % éch. 25/06/2036 | 80 | 51 | 0,00 |
| | | | | | | | | 5,770 % éch. 25/09/2036 | 146 | 55 | 0,00 |
| | | | | | | | | 5,790 % éch. 25/05/2036 | 252 | 224 | 0,02 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Oak Hill European Credit Partners DAC | € 2 873 | € 2 845 | 0,21 | 5,750 % éch. 25/06/2037 | \$ 133 | € 80 | 0,01 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| 4,723 % éch. 20/01/2032 | | | | 6,145 % éch. 25/06/2035 | 2 253 | 1 991 | 0,14 | BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILITÉ | | | |
| OCF Euro CLO DAC | | | | 6,470 % éch. 25/09/2037 | 7 573 | 4 767 | 0,34 | 3,711 % éch. 25/01/2024 (d)(e) € | 1 700 | € 1 696 | 0,12 |
| 4,785 % éch. 15/01/2032 | 3 566 | 3 548 | 0,26 | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust | | | | BONS DU TRÉSOR ALLEMAND | | | |
| Option One Mortgage Loan Trust | | | | 5,770 % éch. 25/09/2037 | 64 | 40 | 0,00 | 3,604 % éch. 20/03/2024 (d)(e) | 1 690 | 1 677 | 0,12 |
| 5,570 % éch. 25/07/2036 | \$ 10 280 | 4 299 | 0,31 | St. Paul's CLO DAC | | | | 3,651 % éch. 21/02/2024 (d)(e) | 7 360 | 7 324 | 0,53 |
| 5,650 % éch. 25/04/2037 | 13 110 | 6 691 | 0,48 | 4,745 % éch. 17/07/2030 | € 1 491 | 1 478 | 0,11 | 3,655 % éch. 20/03/2024 (d)(e) | 9 500 | 9 428 | 0,68 |
| 5,690 % éch. 25/01/2037 | 245 | 126 | 0,01 | Structured Asset Investment Loan Trust | | | | 3,677 % éch. 20/03/2024 (d)(e) | 8 120 | 8 059 | 0,58 |
| 5,800 % éch. 25/04/2037 | 679 | 293 | 0,02 | 5,620 % éch. 25/09/2036 | \$ 20 | 18 | 0,00 | | | | |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | | | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 5 127 | 5 045 | 0,36 | 7,220 % éch. 25/04/2031 | 1 879 | 1 704 | 0,12 | | | | |
| Palmerston Park CLO DAC | | | | Toro European CLO DAC | | | | | | | |
| 4,625 % éch. 18/04/2030 | 947 | 943 | 0,07 | 4,705 % éch. 15/10/2030 | € 890 | 884 | 0,06 | BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 4,885 % éch. 15/07/2030 | 560 | 561 | 0,04 | (0,305) % éch. 09/01/2024 (d)(e) ¥ | 2 497 000 | 16 034 | 1,16 |
| 6,205 % éch. 25/08/2035 | \$ 355 | 312 | 0,02 | 4,908 % éch. 12/01/2032 | 9 200 | 9 127 | 0,66 | (0,271) % éch. 09/01/2024 (d)(e) | 7 314 000 | 46 966 | 3,38 |
| Purple Finance CLO DAC | | | | Voya Euro CLO DAC | | | | (0,289) % éch. 09/01/2024 (d)(e) | 35 000 | 225 | 0,02 |
| 4,993 % éch. 20/04/2032 | € 1 200 | 1 187 | 0,09 | 4,715 % éch. 15/10/2030 | 3 644 | 3 611 | 0,26 | (0,260) % éch. 09/01/2024 (d)(e) | 34 000 | 218 | 0,01 |
| Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | | | | | | | | |
| 5,879 % éch. 25/06/2037 | \$ 3 494 | 868 | 0,06 | | | | | | | | |
| 7,238 % éch. 25/09/2037 | 210 | 81 | 0,01 | | | | | | | | |
| 7,270 % éch. 25/09/2037 | 141 | 105 | 0,01 | | | | | | | | |
| Residential Asset Mortgage Products Trust | | | | | | | | | | | |
| 6,415 % éch. 25/10/2035 | 3 000 | 2 257 | 0,16 | | | | | | | | |
| Securitized Asset Securities Corp. Trust | | | | | | | | | | | |
| 5,730 % éch. 25/11/2036 | 659 | 548 | 0,04 | | | | | | | | |
| 6,430 % éch. 25/01/2036 | 3 300 | 2 722 | 0,20 | | | | | | | | |
| Rockford Tower Europe CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,968 % éch. 20/12/2031 | € 521 | 517 | 0,04 | | | | | | | | |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | | | | | | | | | |
| 5,650 % éch. 25/07/2036 | \$ 187 | 59 | 0,00 | | | | | | | | |
| 5,790 % éch. 25/07/2036 | 183 | 57 | 0,00 | | | | | | | | |
| 5,950 % éch. 25/07/2036 | 157 | 49 | 0,00 | | | | | | | | |
| 5,970 % éch. 25/03/2036 | 2 976 | 1 650 | 0,12 | | | | | | | | |
| 5,970 % éch. 25/05/2036 | 645 | 306 | 0,02 | | | | | | | | |
| Segovia European CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,745 % éch. 18/01/2031 | € 237 | 235 | 0,02 | | | | | | | | |
| 4,873 % éch. 20/07/2032 | 2 000 | 1 975 | 0,14 | | | | | | | | |
| SLM Student Loan Trust | | | | | | | | | | | |
| 6,252 % éch. 25/03/2026 | \$ 13 052 | 11 697 | 0,84 | | | | | | | | |
| Soundview Home Loan Trust | | | | | | | | | | | |
| 4,350 % éch. 25/04/2035 | 1 650 | 1 472 | 0,11 | | | | | | | | |
| 5,580 % éch. 25/02/2037 | 257 | 64 | 0,00 | | | | | | | | |
| 5,650 % éch. 25/02/2037 | 380 | 96 | 0,01 | | | | | | | | |

INSTRUMENTS À COURT TERME

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| BONS DU TRÉSOR ALLEMAND | | | |
| 3,604 % éch. 20/03/2024 (d)(e) | 1 690 | 1 677 | 0,12 |
| 3,651 % éch. 21/02/2024 (d)(e) | 7 360 | 7 324 | 0,53 |
| 3,655 % éch. 20/03/2024 (d)(e) | 9 500 | 9 428 | 0,68 |
| 3,677 % éch. 20/03/2024 (d)(e) | 8 120 | 8 059 | 0,58 |
| | | 26 488 | 1,91 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | |
| (0,305) % éch. 09/01/2024 (d)(e) ¥ | 2 497 000 | 16 034 | 1,16 |
| (0,271) % éch. 09/01/2024 (d)(e) | 7 314 000 | 46 966 | 3,38 |
| (0,289) % éch. 09/01/2024 (d)(e) | 35 000 | 225 | 0,02 |
| (0,260) % éch. 09/01/2024 (d)(e) | 34 000 | 218 | 0,01 |
| | | 63 443 | 4,57 |

Total des Instruments à court terme

Total des Valeurs mobilières

€ 1 698 144 122,41

ACTIONS

FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (g) | 1 494 064 | 16 898 | 1,22 |

FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g) | 1 198 900 | 118 616 | 8,55 |

Total des Fonds d'investissement

€ 135 514 9,77

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--|------------------|--|--|---------------------|
| COM | 3,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | € 133 900 | Land Brandenburg 0,010 % éch. 26/06/2028 | € (80 782) | € 133 900 | € 133 954 | 9,66 |
| | | | | | Landesbank Baden-Wuerttemberg 0,010 % éch. 08/04/2025 | (57 106) | | | |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 4 501 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | (4 156) | 4 075 | 4 075 | 0,29 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | € (142 044) | € 137 975 | €138 029 | 9,95 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 204 | € 845 | 0,06 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 3 569 | (2 206) | (0,16) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 006 | 3 493 | 0,25 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 662 | 3 309 | 0,24 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 21 | (170) | (0,01) |
| | | | | € 5 271 | 0,38 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | € 5 271 | 0,38 |

Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 13 000 | € (116) | (0,01) |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 2 400 | (17) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 1 100 | 16 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2025 | 200 | 3 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 8 700 | 66 | 0,00 |
| | | | | € (48) | (0,01) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-39 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/12/2027 | \$ 686 | € 47 | 0,01 |
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | 16 830 | 716 | 0,05 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 36 900 | 181 | 0,01 |
| | | | | € 944 | 0,07 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 2 300 | € 343 | 0,02 |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 | 20/10/2033 | 900 | 91 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 5 300 | (346) | (0,02) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/06/2032 | ¥ 5 164 600 | 863 | 0,06 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,868 | 05/05/2032 | \$ 15 100 | (1 787) | (0,13) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,040 | 25/05/2032 | 7 800 | (811) | (0,06) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,068 | 11/05/2032 | 15 400 | (1 600) | (0,12) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,153 | 18/05/2032 | 15 400 | (1 482) | (0,11) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 39 900 | 3 180 | 0,23 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 3 085 | (99) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 06/03/2033 | 2 600 | (60) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 14/06/2033 | 9 700 | (177) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 12/07/2053 | 2 800 | 17 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,420 | 24/05/2033 | 7 600 | (79) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,425 | 01/03/2033 | 40 200 | (530) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450 | 07/03/2033 | 5 000 | (57) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/06/2030 | 12 200 | (60) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 194 100 | (2 417) | (0,17) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 21/06/2033 | 8 100 | (20) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 248 300 | (364) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 1 800 | (16) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 10/07/2033 | 4 600 | 40 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 1 200 | (15) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730 | 03/08/2033 | 1 300 | 21 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735 | 07/08/2033 | 1 500 | 26 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 74 000 | (1 094) | (0,08) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 302 700 | (949) | (0,07) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 15/03/2030 | 46 000 | 1 048 | 0,08 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 12/07/2033 | 4 000 | 67 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 1 200 | (21) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,760 | 23/08/2033 | 4 700 | 93 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 5 000 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 05/09/2028 | 8 500 | 99 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 1 200 | 17 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 30/08/2033 | 2 300 | 53 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 1 200 | (27) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 700 | 63 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 1 200 | (29) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 2 200 | (56) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870 | 17/10/2053 | 700 | 67 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880 | 16/10/2053 | 700 | 68 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 30/08/2033 | 4 700 | 144 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 2 400 | (78) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 4 500 | 190 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 2 200 | (84) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 2 100 | 110 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 2 100 | 113 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200 | 18/10/2033 | 1 800 | 100 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 2 200 | 126 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 | 23/10/2033 | 1 100 | 64 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 2 200 | (118) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255 | 23/10/2033 | 1 100 | 66 | 0,00 |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393 % | 25/10/2033 | \$ 1 100 | € 78 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 1 100 | 82 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 1 300 | 98 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 2 200 | 168 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,874 | 02/01/2026 | BRL 10 600 | (8) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,899 | 02/01/2026 | 5 400 | (3) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,939 | 02/01/2026 | 9 200 | (4) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,998 | 04/01/2027 | 15 500 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,037 | 04/01/2027 | 4 200 | 1 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,041 | 04/01/2027 | 17 100 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,052 | 02/01/2026 | 21 000 | (3) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,085 | 02/01/2026 | 20 900 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,090 | 04/01/2027 | 32 200 | 10 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,105 | 02/01/2026 | 20 700 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,138 | 04/01/2027 | 8 000 | 4 | 0,00 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | CAD 23 100 | 330 | 0,02 |
| À payer | EURIBOR EUR à 3 mois | 0,500 | 09/02/2024 | € 115 000 | (289) | (0,02) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 3 mois | 3,150 | 30/01/2025 | 667 700 | (745) | (0,05) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,360 | 07/08/2028 | ZAR 26 500 | 21 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,380 | 04/08/2028 | 11 700 | 10 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,400 | 07/08/2028 | 26 500 | 23 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 31/07/2028 | 12 600 | 11 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 04/08/2028 | 28 300 | 25 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 07/08/2028 | 7 900 | 7 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,415 | 31/07/2028 | 10 100 | 9 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,415 | 04/08/2028 | 11 800 | 11 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,420 | 31/07/2028 | 37 700 | 35 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,421 | 04/08/2028 | 12 000 | 11 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,426 | 01/08/2028 | 15 200 | 14 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,428 | 31/07/2028 | 25 100 | 23 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,460 | 01/08/2028 | 25 700 | 26 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,460 | 02/08/2028 | 26 100 | 26 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,464 | 02/08/2028 | 26 100 | 26 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,543 | 04/08/2028 | 12 000 | 14 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,550 | 03/08/2028 | 24 200 | 28 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | AUD 13 200 | 239 | 0,02 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,830 | 09/12/2052 | € 26 700 | 1 401 | 0,10 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,520 | 07/07/2027 | 9 600 | (397) | (0,03) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 40 400 | (4 173) | (0,30) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 1 800 | (24) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 2 600 | (48) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 2 100 | (65) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 1 400 | (47) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 3 100 | (61) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 1 700 | (38) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,970 | 15/12/2033 | 2 200 | (82) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 1 800 | (70) | (0,01) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 293 450 | 16 980 | 1,22 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 1 300 | (59) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,128 | 04/12/2033 | 1 000 | (50) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 1 600 | (83) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 1 300 | (40) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 563 000 | 5 818 | 0,42 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 06/11/2033 | 1 600 | (95) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 1 200 | (41) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 08/11/2028 | 2 600 | (88) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 21/08/2033 | 1 600 | 108 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 800 | (51) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 1 700 | (111) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,450 | 20/10/2028 | 2 700 | 122 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 11 300 | (180) | (0,01) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,300 | 16/06/2028 | MXN 20 600 | (6) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,444 | 25/07/2028 | 48 100 | (20) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,471 | 26/07/2028 | 24 200 | (9) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,512 | 24/07/2028 | 36 400 | (10) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,550 | 27/07/2028 | 12 300 | (2) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,556 | 27/07/2028 | 73 000 | (13) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,600 | 31/07/2028 | 23 500 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,620 | 28/07/2028 | 12 000 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,636 | 28/07/2028 | 23 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,640 | 28/07/2028 | 4 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,650 | 28/07/2028 | 12 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,660 | 28/07/2028 | 11 900 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,500 | 15/01/2025 | € 68 100 | (64) | 0,00 |
| | | | | | € 13 466 | 0,97 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | € 14 362 | 1,03 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 700 | € (3) | € (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 700 | (3) | (1) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 1 200 | (5) | (8) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 2 400 | (10) | (27) | 0,00 |
| CBK | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 1 200 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 2 400 | (10) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 2 300 | (9) | (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 2 300 | (9) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 1 000 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 1 600 | (5) | (16) | 0,00 |
| FAR | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 1 000 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 1 600 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,273 | 16/01/2024 | 1 300 | (5) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 1 300 | (6) | (8) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 1 100 | (4) | (13) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,723 | 16/01/2024 | 1 300 | (5) | (2) | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 1 300 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 1 100 | (4) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 2 300 | (8) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 1 200 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 2 300 | (9) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 2 300 | (11) | (22) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 2 300 | (11) | (27) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 2 300 | (10) | (34) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 2 300 | (8) | (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 1 200 | (5) | (2) | 0,00 |
| GST | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 2 300 | (9) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 2 300 | (11) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 2 300 | (11) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 2 600 | (5) | (8) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 2 600 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 1 200 | (5) | (3) | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 1 300 | (5) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 18/01/2024 | 1 200 | (5) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 1 100 | (5) | (16) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 1 200 | (5) | (6) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 1 300 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 18/01/2024 | 1 200 | (5) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 1 100 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 1 600 | (6) | (11) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 2 200 | (7) | (31) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 1 600 | (6) | (1) | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 2 200 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 2 500 | (11) | (13) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 1 200 | (5) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 1 100 | (5) | (16) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 2 500 | (11) | (40) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 2 500 | (11) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 1 200 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 1 100 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 2 500 | (11) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 1 500 | (6) | (4) | 0,00 |
| UAG | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 1 500 | (6) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 1 200 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 1 200 | (5) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | | € (361) | € (393) | (0,03) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | ADLER Real Estate AG | 5,000 % | 20/12/2026 | € 1 200 | € (6) | € (207) | € (213) | (0,01) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|---------|------|
| BPS | 01/2024 | AUD | 567 | € 342 | € 0 | € (9) | € (9) | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 27 631 | \$ 30 219 | 5 | (286) | (281) | (0,02) | |
| | 01/2024 | £ | 1 040 | € 1 206 | 6 | 0 | 6 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 16 606 | 15 233 | 203 | 0 | 203 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 178 | ZAR 3 304 | 2 | 0 | 2 | 0,00 | |
| | 02/2024 | TWD | 493 | \$ 16 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 267 | 41 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 176 | IDR 2 719 663 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | DKK | 743 | € 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 5 285 | \$ 5 785 | 0 | (49) | (49) | 0,00 | |
| BRC | 01/2024 | ¥ | 54 300 | € 346 | 0 | (2) | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 14 632 | 13 484 | 241 | 0 | 241 | 0,02 | |
| | 01/2024 | | 1 473 | TRY 44 155 | 3 | (1) | 2 | 0,00 | |
| | 02/2024 | TRY | 59 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 2 402 | TRY 73 239 | 2 | (8) | (6) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 4 482 | 140 627 | 0 | (36) | (36) | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 4 520 | 145 688 | 0 | (55) | (55) | 0,00 | |
| | 01/2024 | BRL | 70 418 | \$ 14 463 | 0 | (31) | (31) | 0,00 | |
| | 01/2024 | MXN | 107 439 | 6 026 | 0 | (263) | (263) | (0,02) | |
| | 01/2024 | \$ | 17 800 | € 16 368 | 258 | 0 | 258 | 0,02 | |
| CBK | 01/2024 | | 5 650 | MXN 103 209 | 378 | 0 | 378 | 0,03 | |
| | 04/2024 | | 14 463 | BRL 71 131 | 54 | 0 | 54 | 0,00 | |
| | 06/2024 | | 15 | KRW 18 727 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 12 574 | ¥ 2 029 876 | 467 | 0 | 467 | 0,03 | |
| | 01/2024 | | 4 924 | \$ 5 317 | 0 | (112) | (112) | (0,01) | |
| | 01/2024 | MXN | 78 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 13 986 | BRL 70 459 | 470 | 0 | 470 | 0,03 | |
| | 01/2024 | | 4 698 | € 4 283 | 31 | 0 | 31 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 9 404 | MXN 164 936 | 265 | 0 | 265 | 0,02 | |
| | 01/2024 | | 891 | TRY 27 198 | 11 | 0 | 11 | 0,00 | |
| JPM | 01/2024 | | 173 | ZAR 3 226 | 3 | 0 | 3 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 168 | IDR 17 978 700 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 804 | TRY 25 236 | 0 | (8) | (8) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 5 678 | € 6 552 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 6 855 | INR 572 704 | 10 | 0 | 10 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 368 | TRY 11 248 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 934 | \$ 130 | 0 | (2) | (2) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 1 422 | IDR 21 956 651 | 2 | 0 | 2 | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 2 885 | \$ 3 160 | 0 | (25) | (25) | 0,00 | |
| | 01/2024 | MXN | 5 043 | 271 | 0 | (23) | (23) | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | \$ | 2 858 | € 2 616 | 30 | 0 | 30 | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 2 139 | \$ 68 | 0 | (3) | (3) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 1 735 | IDR 26 743 584 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 2 517 | \$ 2 716 | 0 | (58) | (58) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 1 049 | € 1 217 | 7 | 0 | 7 | 0,00 | |
| | 01/2024 | TRY | 114 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 382 891 | € 348 421 | 1 884 | 0 | 1 884 | 0,13 | |
| | 02/2024 | | 4 | TRY 117 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 2 779 | IDR 42 769 560 | 0 | (5) | (5) | 0,00 | |
| | 06/2024 | | 2 | KRW 2 565 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| RBC | 04/2024 | | 13 | MXN 236 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| RYL | 01/2024 | ¥ | 9 880 000 | € 63 248 | 0 | (224) | (224) | (0,02) | |
| SCX | 01/2024 | CAD | 3 090 | 2 071 | 0 | (50) | (50) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 121 097 | 139 477 | 0 | (246) | (246) | (0,02) | |
| | 03/2024 | \$ | 155 | IDR 2 380 042 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | TRY | 4 128 | \$ 140 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 16 | ZAR 313 | 1 | 0 | 1 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 140 | TRY 4 257 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| | | | | | | € 4 334 | € (1 503) | € 2 831 | 0,20 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | | € 2 225 | 0,16 | |
| Total des Investissements | | | | | | | € 1 993 491 | 143,70 | |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | | € (606 264) | (43,70) | |
| Actifs nets | | | | | | | € 1 387 227 | 100,00 | |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

- (d) Titre à coupon zéro.
 (e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
 (f) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
 (g) Affilié au Fonds.
 (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,06 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|--------------|---------|--------------|---------------------|
| Corestate Capital Holding S.A. | 22/08/2023 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG 2,129 % éch. 24/11/2026 | 11/01/2023 | 2 385 | 2 377 | 0,17 |
| Deutsche Bank AG 3,035 % éch. 28/05/2032 | 29/07/2021 | 173 | 151 | 0,01 |
| | | € 2 558 | € 2 528 | 0,18 |

- (i) Des titres d'une juste valeur globale de 4 450 € (31 décembre 2022 : 0 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 49 537 € (31 décembre 2022 : 41 642 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 317 € (31 décembre 2022 : 5 462 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|--------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 1 696 971 | € 1 173 | € 1 698 144 |
| Fonds d'investissement | 135 514 | 0 | 0 | 135 514 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 137 975 | 0 | 137 975 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (1 531) | 23 389 | 0 | 21 858 |
| Totaux | € 133 983 | € 1 858 335 | € 1 173 | € 1 993 491 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|--------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 1 098 581 | € 1 860 | € 1 100 441 |
| Fonds d'investissement | 134 815 | 0 | 0 | 134 815 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 120 458 | 0 | 120 458 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 3 623 | (5 077) | 0 | (1 454) |
| Totaux | € 138 438 | € 1 213 962 | € 1 860 | € 1 354 260 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 3,200 % | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (321) | € (324) | (0,03) |
| BRC | 3,250 | 30/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (3 754) | (3 765) | (0,27) |
| JML | 2,250 | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (179) | (179) | (0,01) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | € (4 268) | (0,31) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | € (4) | € 0 | € (4) | € 149 | € (272) | € (123) |
| BPS | (117) | 0 | (117) | 275 | (290) | (15) |
| BRC | 95 | 0 | 95 | 175 | 0 | 175 |
| CBK | 361 | (290) | 71 | (16) | 0 | (16) |
| FAR | (26) | 0 | (26) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 1 014 | (643) | 371 | (3 563) | 3 382 | (181) |
| GST | (221) | 317 | 96 | (289) | 328 | 39 |
| JPM | (74) | 0 | (74) | (2 314) | 1 752 | (562) |
| MBC | (22) | 0 | (22) | 3 869 | (3 429) | 440 |
| MYC | (82) | 0 | (82) | S/O | S/O | S/O |
| MYI | 1 828 | (3 757) | (1 929) | (128) | 0 | (128) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (168) | 0 | (168) |
| RYL | (224) | (40) | (264) | 83 | 0 | 83 |
| SCX | (297) | 0 | (297) | (42) | 0 | (42) |
| SSB | S/O | S/O | S/O | 428 | (272) | 156 |
| UAG | (6) | 0 | (6) | 65 | 0 | 65 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 54,60 | 60,94 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 67,81 | 19,96 |
| Autres valeurs mobilières | 0,00 | 0,44 |
| Fonds d'investissement | 9,77 | 9,96 |
| Contrats de mise en pension | 9,95 | 8,90 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,38 | 0,20 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 1,03 | (0,20) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,16 | (0,11) |
| Contrats de prise en pension | (0,31) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 0,88 | 2,26 |
| Obligations et billets privés | 29,42 | 43,78 |
| Obligations et billets convertibles | 0,07 | 0,11 |
| Agences du gouvernement américain | 47,18 | 6,78 |
| Obligations du Trésor américain | 1,15 | S/O |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 21,02 | 3,46 |
| Titres adossés à des actifs | 14,58 | 11,18 |
| Émissions souveraines | 1,48 | 1,15 |
| Actions ordinaires | 0,03 | S/O |
| Instruments à court terme | 6,60 | 12,62 |
| Fonds d'investissement | 9,77 | 9,96 |
| Contrats de mise en pension | 9,95 | 8,90 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,38 | 0,20 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01) | (0,02) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,07 | 0,16 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,97 | (0,34) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,03) | (0,24) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01) | (0,02) |
| Contrats de change à terme | 0,20 | 0,15 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (43,70) | (0,09) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | |
| AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % éch. 06/02/2027 | € 500 | € 514 | 0,06 |
| Banco BPM SpA 3,750 % éch. 27/06/2028 | 300 | 308 | 0,03 |
| Banco di Desio e della Brianza SpA 4,000 % éch. 13/03/2028 | 1 600 | 1 648 | 0,18 |
| Barclays PLC 5,829 % éch. 09/05/2027 | \$ 1 900 | 1 736 | 0,19 |
| Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025 | € 1 100 | 1 102 | 0,12 |
| Fédération des Caisses Desjardins du Québec 3,250 % éch. 18/04/2028 | 2 600 | 2 635 | 0,29 |
| Hamburg Commercial Bank AG 4,875 % éch. 17/03/2025 | 150 | 151 | 0,02 |
| Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 12 | 1 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 3 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 01/10/2050 | 16 | 2 | 0,00 |
| Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % éch. 23/05/2059 | € 1 600 | 1 566 | 0,17 |
| National Bank of Canada 3,500 % éch. 25/04/2028 | 100 | 102 | 0,01 |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 01/10/2050 | 19 | 2 | 0,00 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 10 | 1 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2047 | 1 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 01/10/2050 | 22 | 3 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,500 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 5,000 % éch. 01/10/2053 | 10 | 1 | 0,00 |
| Permanent TSB Group Holdings PLC 5,250 % éch. 30/06/2025 | € 100 | 100 | 0,01 |
| Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| SLM Student Loan Trust 4,475 % éch. 15/12/2033 | € 402 | 374 | 0,04 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,267 % éch. 18/06/2026 | 900 | 836 | 0,09 |
| 3,602 % éch. 16/02/2026 | 100 | 101 | 0,01 |
| UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,625 % éch. 15/02/2026 | 100 | 101 | 0,01 |
| UniCredit SpA 3,375 % éch. 31/01/2027 | 1 500 | 1 519 | 0,16 |
| | | <u>12 803</u> | <u>1,39</u> |
| INDUSTRIE | | | |
| Nokia Oyj 4,375 % éch. 21/08/2031 | 100 | 101 | 0,01 |
| SK Hynix, Inc. 1,000 % éch. 19/01/2024 | \$ 200 | 181 | 0,02 |
| | | <u>282</u> | <u>0,03</u> |
| Total Obligations et billets privés | | <u>13 085</u> | <u>1,42</u> |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Fannie Mae 4,560 % éch. 01/08/2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,692 % éch. 25/07/2037 | 5 | 4 | 0,00 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 4,000 % éch. 01/02/2054 | 33 850 | 29 012 | 3,14 |
| 4,500 % éch. 01/02/2054 | 30 000 | 26 344 | 2,85 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 6,000 % éch. 01/02/2054 | \$ 16 500 | € 15 167 | 1,64 |
| | | <u>70 528</u> | <u>7,63</u> |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) | | | |
| 0,125 % éch. 15/07/2024 | 518 | 461 | 0,05 |
| 0,125 % éch. 15/01/2032 | 3 885 | 3 091 | 0,33 |
| 0,500 % éch. 15/01/2028 | 1 996 | 1 710 | 0,19 |
| 1,125 % éch. 15/01/2033 | 4 958 | 4 249 | 0,46 |
| 1,375 % éch. 15/07/2033 | 6 382 | 5 606 | 0,61 |
| 1,625 % éch. 15/10/2027 | 23 681 | 21 281 | 2,30 |
| | | <u>36 398</u> | <u>3,94</u> |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHECAIRES NON EMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Alba PLC 4,085 % éch. 15/12/2038 | € 180 | 174 | 0,02 |
| Atlas Funding PLC 6,348 % éch. 20/01/2061 | £ 774 | 898 | 0,10 |
| Barley Hill PLC 6,118 % éch. 27/08/2058 | 76 | 88 | 0,01 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 5,142 % éch. 25/07/2033 | \$ 3 | 3 | 0,00 |
| Brants Bridge PLC 6,120 % éch. 14/06/2066 | £ 3 258 | 3 753 | 0,41 |
| Canada Square Funding PLC 6,000 % éch. 17/06/2058 | 1 451 | 1 667 | 0,18 |
| 6,070 % éch. 17/01/2059 | 1 760 | 2 019 | 0,22 |
| 6,170 % éch. 17/06/2058 | 292 | 336 | 0,04 |
| Charter Mortgage Funding PLC 5,796 % éch. 16/01/2057 | 54 | 62 | 0,01 |
| Cheshire PLC 6,120 % éch. 20/08/2045 | 1 115 | 1 285 | 0,14 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates 4,858 % éch. 25/07/2033 | \$ 3 | 2 | 0,00 |
| Dilosk RMBS DAC 4,863 % éch. 20/07/2061 | € 382 | 383 | 0,04 |
| 4,956 % éch. 20/10/2062 | 1 411 | 1 417 | 0,15 |
| Domi BV 4,815 % éch. 15/04/2054 | 784 | 786 | 0,08 |
| 4,882 % éch. 15/11/2052 | 736 | 738 | 0,08 |
| Dutch Property Finance BV 4,702 % éch. 28/10/2059 | 2 858 | 2 857 | 0,31 |
| 4,852 % éch. 28/04/2064 | 190 | 190 | 0,02 |
| 5,202 % éch. 28/04/2050 | 105 | 104 | 0,01 |
| Eurohome UK Mortgages PLC 5,490 % éch. 15/06/2044 | £ 100 | 113 | 0,01 |
| Friary PLC 0,000 % éch. 21/10/2071 | 1 600 | 1 853 | 0,20 |
| Great Hall Mortgages PLC 4,062 % éch. 18/03/2039 | € 19 | 19 | 0,00 |
| 5,812 % éch. 18/06/2039 | \$ 11 | 10 | 0,00 |
| Jubilee Place BV 4,985 % éch. 17/10/2057 | € 83 | 83 | 0,01 |
| Jupiter Mortgage PLC 6,021 % éch. 20/07/2060 | £ 1 250 | 1 443 | 0,16 |
| Landmark Mortgage Securities PLC 5,539 % éch. 17/06/2039 | 152 | 170 | 0,02 |
| London Wall Mortgage Capital PLC 5,970 % éch. 15/05/2051 | 614 | 704 | 0,08 |
| Ludgate Funding PLC 5,539 % éch. 01/12/2060 | 175 | 195 | 0,02 |
| 5,574 % éch. 01/01/2061 | 69 | 77 | 0,01 |
| Mortimer BTL PLC 0,000 % éch. 22/12/2056 | 1 000 | 1 157 | 0,13 |
| 5,920 % éch. 23/06/2053 | 1 388 | 1 592 | 0,17 |
| Newgate Funding PLC 4,525 % éch. 15/12/2050 | € 628 | 616 | 0,07 |
| Pierpont BTL PLC 6,320 % éch. 21/09/2054 | £ 286 | 330 | 0,04 |
| Precise Mortgage Funding PLC 6,420 % éch. 12/12/2055 | 116 | 134 | 0,01 |
| Primrose Residential DAC 4,626 % éch. 24/03/2061 | € 292 | 291 | 0,03 |
| 4,876 % éch. 24/10/2061 | 476 | 474 | 0,05 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Ripon Mortgages PLC 5,920 % éch. 28/08/2056 | £ 0 | € 0 | 0,00 |
| RMAC Securities PLC 5,489 % éch. 12/06/2044 | 172 | 190 | 0,02 |
| Silverstone Master Issuer PLC 5,510 % éch. 21/01/2070 | 1 516 | 1 744 | 0,19 |
| Stratton Mortgage Funding PLC 5,920 % éch. 12/12/2043 | 1 394 | 1 598 | 0,17 |
| 6,069 % éch. 25/09/2051 | 245 | 283 | 0,03 |
| 6,120 % éch. 12/03/2052 | 172 | 198 | 0,02 |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,970 % éch. 19/07/2035 | \$ 9 | 8 | 0,00 |
| Thornburg Mortgage Securities Trust 6,110 % éch. 25/09/2043 | 16 | 14 | 0,00 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 6,570 % éch. 20/05/2045 | £ 3 117 | 3 602 | 0,39 |
| Tower Bridge Funding PLC 0,000 % éch. 20/01/2066 | 1 800 | 2 081 | 0,22 |
| (a) 5,940 % éch. 20/12/2063 | 99 | 113 | 0,01 |
| Tudor Rose Mortgages 5,820 % éch. 20/06/2048 | 1 029 | 1 181 | 0,13 |
| Twin Bridges PLC 5,880 % éch. 12/09/2055 | 2 321 | 2 657 | 0,29 |
| 5,990 % éch. 01/12/2055 | 606 | 694 | 0,07 |
| 6,432 % éch. 15/05/2056 | 1 500 | 1 735 | 0,19 |
| | | <u>42 121</u> | <u>4,56</u> |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Accunia European CLO DAC 4,895 % éch. 15/10/2030 | € 81 | 81 | 0,01 |
| 4,915 % éch. 15/07/2030 | 426 | 426 | 0,05 |
| Ares European CLO DAC 4,625 % éch. 15/10/2030 | 190 | 188 | 0,02 |
| 4,843 % éch. 20/04/2032 | 1 000 | 984 | 0,11 |
| 5,122 % éch. 21/10/2033 | 1 100 | 1 089 | 0,12 |
| Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV 4,553 % éch. 21/09/2031 | 1 412 | 1 416 | 0,15 |
| Aurium CLO DAC 4,635 % éch. 16/04/2030 | 1 783 | 1 763 | 0,19 |
| Avoca CLO DAC 4,855 % éch. 15/04/2033 | 2 000 | 1 966 | 0,21 |
| Avoca Static CLO DAC 5,690 % éch. 15/10/2030 | 1 700 | 1 699 | 0,18 |
| Bain Capital Euro CLO DAC 4,733 % éch. 20/01/2032 | 197 | 194 | 0,02 |
| Bavarian Sky S.A. 4,309 % éch. 20/11/2031 | 1 400 | 1 401 | 0,15 |
| BBVA Consumer Auto 0,270 % éch. 20/07/2031 | 30 | 29 | 0,00 |
| Black Diamond CLO DAC 4,853 % éch. 20/01/2032 | 302 | 301 | 0,03 |
| 4,982 % éch. 15/05/2032 | 977 | 965 | 0,10 |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 1,050 % éch. 15/01/2031 | 99 | 94 | 0,01 |
| 4,875 % éch. 15/01/2033 | 400 | 394 | 0,04 |
| BNPP AM Euro CLO DAC 4,615 % éch. 15/10/2031 | 246 | 243 | 0,03 |
| Bumper BE NV/S.A. 4,576 % éch. 23/10/2031 | 505 | 506 | 0,06 |
| Bumper De S.A. 4,456 % éch. 23/08/2032 | 3 000 | 3 006 | 0,33 |
| Cairn CLO DAC 4,745 % éch. 15/10/2031 | 600 | 590 | 0,06 |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,752 % éch. 15/11/2031 | 299 | 295 | 0,03 |
| Cars Alliance Auto Leases France 4,503 % éch. 21/10/2038 | 3 000 | 3 009 | 0,33 |
| Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 4,653 % éch. 15/12/2029 | 380 | 381 | 0,04 |
| Compartment VCL 4,273 % éch. 21/08/2029 | 1 677 | 1 678 | 0,18 |
| Contego CLO DAC 4,785 % éch. 15/01/2031 | 1 797 | 1 780 | 0,19 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Cumulus Static CLO DAC 5,499 % éch. 25/04/2033 | € 1 800 | € 1 799 | 0,20 | Red & Black Auto Italy SRL 4,865 % éch. 28/07/2034 | 1 412 | 1 418 | 0,15 | Obligation internationale du gouvernement néerlandais 0,000 % éch. 15/01/2038 (b) | € 27 300 | € 19 326 | 2,09 |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,652 % éch. 21/07/2030 | 1 687 | 1 668 | 0,18 | Red & Black Auto Lease France 4,556 % éch. 27/06/2035 | € 5 900 | € 5 910 | 0,64 | 0,000 % éch. 15/01/2052 (b) | 35 500 | 18 304 | 1,98 |
| Driver UK Multi-Compartment S.A. 5,847 % éch. 25/04/2031 | € 1 600 | 1 850 | 0,20 | Revocar UG 4,513 % éch. 21/04/2036 | 254 | 255 | 0,03 | 2,000 % éch. 15/01/2054 | 10 600 | 9 573 | 1,04 |
| Dryden Euro CLO DAC 4,752 % éch. 15/05/2032 | € 3 070 | 3 027 | 0,33 | SC Germany S.A. Compartment Consumer 4,578 % éch. 15/09/2037 | 1 600 | 1 607 | 0,17 | 2,750 % éch. 15/01/2047 | 28 950 | 30 359 | 3,29 |
| FCT CA Leasing 4,736 % éch. 26/02/2042 | 1 439 | 1 444 | 0,16 | Silver Arrow Athlon NL BV 4,576 % éch. 26/04/2031 | 533 | 533 | 0,06 | 4,000 % éch. 15/01/2037 | 7 100 | 8 287 | 0,90 |
| FTA Santander Consumo 4,773 % éch. 21/03/2036 | 1 555 | 1 558 | 0,17 | Silver Arrow S.A. 4,313 % éch. 15/09/2030 | 1 512 | 1 514 | 0,16 | Région Wallonne Belgique 3,500 % éch. 15/03/2043 | 2 000 | 2 021 | 0,22 |
| Ginkgo Personal Loans 4,666 % éch. 23/09/2044 | 1 600 | 1 605 | 0,17 | SLM Student Loan Trust 4,475 % éch. 15/12/2033 | 119 | 110 | 0,01 | République d'Allemagne 1,800 % éch. 15/08/2053 (g) | 1 200 | 1 083 | 0,12 |
| Ginkgo Sales Finance 4,576 % éch. 25/11/2049 | 221 | 222 | 0,02 | Tikehau CLO DAC 4,844 % éch. 04/08/2034 | 400 | 395 | 0,04 | 2,500 % éch. 04/07/2044 | 13 500 | 13 963 | 1,51 |
| Harvest CLO DAC 4,725 % éch. 15/07/2031 | 300 | 296 | 0,03 | Toro European CLO DAC 4,812 % éch. 15/02/2034 | 400 | 395 | 0,04 | 4,250 % éch. 04/07/2039 | 1 400 | 1 763 | 0,19 |
| 4,815 % éch. 15/01/2032 | 2 900 | 2 863 | 0,31 | Vessey Park CLO DAC 4,947 % éch. 16/11/2032 | 2 000 | 1 977 | 0,21 | 4,750 % éch. 04/07/2040 | 13 300 | 17 810 | 1,93 |
| 4,872 % éch. 18/11/2030 | 853 | 846 | 0,09 | Voya Euro CLO DAC 4,715 % éch. 15/10/2030 | 339 | 336 | 0,04 | Obligation internationale du gouvernement slovène 0,000 % éch. 12/02/2031 (b) | 4 600 | 3 780 | 0,41 |
| Hayfin Emerald CLO DAC 0,000 % éch. 25/01/2037 (a) | 1 800 | 1 800 | 0,20 | | | | | 1,500 % éch. 25/03/2035 (f) | 16 700 | 14 115 | 1,53 |
| Laurelin DAC 4,713 % éch. 20/10/2031 | 380 | 376 | 0,04 | | | 81 386 | 8,81 | 3,625 % éch. 11/03/2033 | 100 | 106 | 0,01 |
| Madison Park Euro Funding DAC 4,696 % éch. 25/10/2030 | 1 688 | 1 664 | 0,18 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Société Du Grand Paris EPIC 3,500 % éch. 25/05/2043 | 3 300 | 3 360 | 0,36 |
| 4,715 % éch. 15/01/2032 | 2 700 | 2 661 | 0,29 | Action Logement Services 3,625 % éch. 25/05/2043 | 4 800 | 4 925 | 0,53 | Ville de Paris 0,010 % éch. 02/01/2024 | 1 800 | 1 799 | 0,19 |
| Man GLG Euro CLO DAC 4,645 % éch. 15/10/2030 | 204 | 203 | 0,02 | Obligation internationale du gouvernement autrichien 0,850 % éch. 30/06/2120 | 110 | 52 | 0,01 | | | 639 714 | 69,23 |
| 4,835 % éch. 15/01/2030 | 262 | 262 | 0,03 | Obligation internationale du gouvernement belge 1,400 % éch. 22/06/2053 | 12 300 | 8 252 | 0,89 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| 5,779 % éch. 15/10/2036 | 1 000 | 1 002 | 0,11 | 3,750 % éch. 22/06/2045 | 5 400 | 5 974 | 0,65 | BILLETTS DE TRÉSORERIE | | | |
| Marlay Park CLO DAC 4,705 % éch. 15/10/2030 | 1 630 | 1 619 | 0,18 | Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % éch. 05/05/2026 | \$ 600 | 543 | 0,06 | SGS Nederland Holding BV 4,339 % éch. 15/01/2024 | 1 700 | 1 697 | 0,18 |
| Marzio Finance SRL 4,955 % éch. 28/02/2048 | 1 119 | 1 124 | 0,12 | Union européenne 3,000 % éch. 04/03/2053 | € 300 | 295 | 0,03 | 4,339 % éch. 22/01/2024 | 1 800 | 1 795 | 0,20 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust 6,175 % éch. 25/01/2036 | \$ 197 | 176 | 0,02 | Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/05/2072 | 6 750 | 2 832 | 0,31 | 4,481 % éch. 24/01/2024 | 1 800 | 1 795 | 0,19 |
| Oak Hill European Credit Partners DAC 4,723 % éch. 20/01/2032 | € 2 656 | 2 635 | 0,29 | 0,750 % éch. 25/05/2052 | 9 200 | 5 277 | 0,57 | | | 5 287 | 0,57 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC 0,000 % éch. 15/05/2033 | 1 100 | 1 097 | 0,12 | 0,750 % éch. 25/05/2053 | 17 800 | 10 000 | 1,08 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | 4 866 | 4 789 | 0,52 | 1,250 % éch. 25/05/2038 | 15 300 | 12 454 | 1,35 | 10,900 % éch. | | | |
| 5,589 % éch. 15/01/2033 | 3 000 | 3 015 | 0,33 | 1,500 % éch. 25/05/2050 | 20 600 | 14 971 | 1,62 | 04/01/2024 (b)(c) | HUF 798 000 | 2 086 | 0,23 |
| 5,938 % éch. 12/04/2032 | 277 | 278 | 0,03 | 1,750 % éch. 25/05/2066 | 14 370 | 10 291 | 1,11 | Total des Instruments à court terme | | 7 373 | 0,80 |
| Pony S.A. Compartment German Auto Loans 4,502 % éch. 14/11/2032 | 1 600 | 1 605 | 0,17 | 2,000 % éch. 25/05/2048 | 14 800 | 12 246 | 1,32 | TOTAL DES VALEURS MOBILIÈRES | | | |
| Providus CLO DAC 4,732 % éch. 14/05/2031 | 984 | 974 | 0,11 | 2,500 % éch. 25/05/2043 | 39 100 | 36 394 | 3,94 | € 890 605 96,39 | | | |
| | | | | 3,000 % éch. 25/05/2054 | 56 100 | 55 130 | 5,97 | ACTIONS | | | |
| | | | | 3,250 % éch. 25/05/2045 | 40 100 | 41 855 | 4,53 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| | | | | 4,000 % éch. 25/10/2038 | 44 600 | 51 022 | 5,52 | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| | | | | 4,000 % éch. 25/04/2055 | 49 600 | 58 616 | 6,34 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e) | | | |
| | | | | 4,000 % éch. 25/04/2060 | 39 450 | 47 255 | 5,11 | 384 700 38 073 4,12 | | | |
| | | | | 4,500 % éch. 25/04/2041 | 94 850 | 115 681 | 12,52 | Total des Fonds d'investissement | | | |
| | | | | | | | | € 38 073 4,12 | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---|---------------------|--|--|------------------------|
| BPS | 3,650 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | € 50 700 | Bpifrance SACA 3,000 % éch. 10/09/2026 | € (51 761) | € 50 700 | € 50 721 | 5,48 |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 1 805 | Billets de Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | (1 667) | 1 634 | 1 634 | 0,18 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | € (53 428) | € 52 334 | € 52 355 | 5,66 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NEGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|----------------------|---------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Long | 03/2024 | 131 | € 183 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 3 | 9 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 109 | (277) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 1 944 | 9 930 | 1,07 |

Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration Fund (suite)

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 22 | € (58) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 1 498 | (779) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 595 | (847) | (0,09) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 1 074 | (1 760) | (0,19) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 570 | 1 354 | 0,15 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 342 | 753 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 215 | (1 002) | (0,11) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 107 | (659) | (0,07) |
| | | | | € 6 847 | 0,74 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | € 6 847 | 0,74 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|---|------------------------|
| British Telecommunications PLC | 1,000 % | 20/12/2028 | € 100 | € 1 | 0,00 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| À payer/ à recevoir | Taux variable | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|---------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|------------------------|
| À payer ⁽³⁾ | | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 % | 20/03/2026 | £ 15 000 | € 202 | 0,02 |
| À payer ⁽³⁾ | | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,085 | 13/02/2034 | \$ 1 100 | 51 | 0,01 |
| À recevoir | | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 5 300 | (443) | (0,05) |
| À payer | | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 6 300 | 247 | 0,03 |
| À payer | | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,611 | 31/10/2025 | 49 900 | 297 | 0,03 |
| À recevoir ⁽³⁾ | | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 9 500 | (655) | (0,07) |
| À payer ⁽³⁾ | | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 72 000 | 3 006 | 0,32 |
| À payer ⁽³⁾ | | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2039 | 19 800 | 1 134 | 0,12 |
| À payer ⁽³⁾ | | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2044 | 4 800 | 333 | 0,04 |
| À recevoir ⁽³⁾ | | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 20 200 | (502) | (0,05) |
| À payer | | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,345 | 04/04/2044 | 5 300 | 373 | 0,04 |
| | | | | | | € 4 043 | 0,44 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | | € 4 044 | 0,44 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽³⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|------------------------|
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,950 % | 15/09/2025 | 16 000 | € (181) | € (338) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,950 | 15/09/2025 | 16 000 | (181) | (79) | (0,01) |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,900 | 29/08/2025 | 4 500 | (53) | (89) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,900 | 29/08/2025 | 4 500 | (54) | (21) | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,800 | 01/09/2025 | 9 800 | (115) | (181) | (0,02) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,800 | 01/09/2025 | 9 800 | (115) | (49) | (0,01) |
| | | | | | | | € (699) | € (757) | (0,08) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| AZD | 01/2024 | € | 557 | \$ 600 | € 0 | € (14) | 0,00 | |
| BOA | 01/2024 | \$ | 100 | MXN 1 702 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 34 | CNY 243 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 35 256 | \$ 4 904 | 0 | (68) | (0,01) | |
| | 06/2024 | KRW | 3 175 239 | \$ 2 441 | 0 | (28) | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | € | 1 167 | € 1 274 | 0 | (14) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 205 | € 238 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 183 844 | \$ 523 | 0 | (8) | 0,00 | |
| | 01/2024 | KRW | 65 689 | € 50 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 232 | BRL 6 014 | 6 | 6 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 5 770 | € 5 321 | 99 | 99 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 2 | HUF 660 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 100 | IDR 1 546 618 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 2 240 | ZAR 41 523 | 25 | 25 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 61 | CNY 434 | 0 | 0 | 0,00 | |
| BRC | 01/2024 | KRW | 129 230 | \$ 100 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 2 584 | € 2 336 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 282 | MXN 22 499 | 36 | 36 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 99 | ZAR 1 849 | 2 | 2 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNY | 124 | \$ 18 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 1 349 | IDR 20 976 731 | 10 | 10 | 0,00 | |
| CBK | 01/2024 | BRL | 5 768 | \$ 1 185 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 71 161 | € 203 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | KRW | 1 542 854 | € 100 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNY | 12 996 | € 1 833 | 0 | (8) | 0,00 | |
| | 03/2024 | ILS | 146 | € 40 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 100 | IDR 1 543 250 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 1 185 | BRL 5 826 | 4 | 4 | 0,00 | |
| | 06/2024 | KRW | 2 030 924 | \$ 1 579 | 0 | (1) | 0,00 | |
| DUB | 01/2024 | CAD | 2 038 | € 1 389 | 0 | (9) | 0,00 | |
| | 01/2024 | KRW | 64 985 | \$ 50 | 0 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | € | 1 251 | ¥ 201 891 | 46 | 46 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 1 787 | \$ 1 930 | 0 | (41) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 5 056 | € 5 891 | 58 | 58 | 0,01 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 265 | MXN 21 907 | 21 | 21 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 267 | ZAR 23 670 | 23 | 23 | 0,00 | |
| JPM | 01/2024 | £ | 874 | € 1 009 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 333 175 | \$ 950 | 0 | (11) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 150 | IDR 2 308 050 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 50 | KRW 64 807 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 1 850 | BRL 9 072 | 13 | 13 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 839 | \$ 116 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 06/2024 | KRW | 64 252 | € 50 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | € | 1 008 | £ 869 | 0 | (5) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 36 701 | € 33 522 | 305 | 305 | 0,03 | |
| MYI | 01/2024 | € | 2 932 | \$ 3 193 | 0 | (42) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 207 592 | € 590 | 0 | (9) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 140 | € 1 044 | 13 | 13 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 36 | CNY 254 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 100 | IDR 1 549 650 | 1 | 1 | 0,00 | |
| RBC | 03/2024 | TWD | 14 472 | \$ 468 | 0 | (11) | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | CAD | 10 471 | € 7 045 | 0 | (143) | (0,02) | |
| | 01/2024 | £ | 24 476 | € 28 193 | 2 | (49) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 696 | MXN 12 224 | 20 | 20 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNY | 7 680 | \$ 1 086 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 128 186 | € 4 122 | 0 | (113) | (0,01) | |
| | 03/2024 | \$ | 880 | IDR 13 653 162 | 5 | 5 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 225 | INR 102 444 | 2 | 2 | 0,00 | |
| SSB | 03/2024 | TWD | 39 748 | \$ 1 291 | 0 | (24) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 1 463 | INR 122 308 | 2 | 2 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | | 104 | MXN 1 834 | 3 | 3 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 165 | INR 97 446 | 2 | 2 | 0,00 | |
| | | | | | € 699 | € (610) | € 89 | 0,01 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ (668) (0,07)

Total des Investissements

€ 991 235 107,28

Autres actifs et passifs à court terme

€ (67 266) (7,28)

Actifs nets

€ 923 969 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à coupon zéro.
- (c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration Fund (suite)

(e) Affilié au Fonds.

(f) Un titre d'une juste valeur globale de 10 903 € (31 décembre 2022 : 0 €) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(g) Un titre d'une juste valeur globale de 84 € (31 décembre 2022 : 0 €) et un montant en numéraire de 0 € (31 décembre 2022 : 190 €) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 743 € (31 décembre 2022 : 0 €) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 20 472 € (31 décembre 2022 : 4 192 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 888 522 | € 2 083 | € 890 605 |
| Fonds d'investissement | 38 073 | 0 | 0 | 38 073 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 52 334 | 0 | 52 334 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 9 008 | 1 215 | 0 | 10 223 |
| Totaux | € 47 081 | € 942 071 | € 2 083 | € 991 235 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-----------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 103 959 | € 0 | € 103 959 |
| Fonds d'investissement | 4 940 | 0 | 0 | 4 940 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 500 | 0 | 1 500 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (7 079) | (7 962) | 0 | (15 041) |
| Totaux | € (2 139) | € 97 497 | € 0 | € 95 358 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BRC | 3,250 % | 13/07/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (5 175) | € (5 254) | (0,57) |
| | 3,250 | 31/07/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (5 159) | (5 231) | (0,56) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | € (10 485) | (1,13) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | € (14) | € 0 | € (14) | € S/O | € S/O | € S/O |
| BOA | (96) | 84 | (12) | (20) | 0 | (20) |
| BPS | 108 | 0 | 108 | (57) | 190 | 133 |
| BRC | 45 | 0 | 45 | (84) | 0 | (84) |
| CBK | (426) | 0 | (426) | (44) | 0 | (44) |
| DUB | (9) | 0 | (9) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | (3) | 0 | (3) | (46) | 0 | (46) |
| GST | (230) | 0 | (230) | (68) | 0 | (68) |
| JPM | S/O | S/O | S/O | (85) | 0 | (85) |
| MBC | 300 | (470) | (170) | 3 | 0 | 3 |
| MYC | S/O | S/O | S/O | 4 | 0 | 4 |
| MYI | (37) | 0 | (37) | 33 | 0 | 33 |
| RBC | (11) | 0 | (11) | 27 | 0 | 27 |
| RYL | S/O | S/O | S/O | (3) | 0 | (3) |
| SCX | (278) | 0 | (278) | (8) | 0 | (8) |
| SSB | (22) | 0 | (22) | 167 | 0 | 167 |
| UAG | 5 | 0 | 5 | 5 | 0 | 5 |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 84,69 | 87,44 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 11,18 | 7,03 |
| Autres valeurs mobilières | 0,52 | S/O |
| Fonds d'investissement | 4,12 | 4,49 |
| Contrats de mise en pension | 5,66 | 1,36 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,74 | (6,40) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,44 | (7,11) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,07) | (0,16) |
| Contrats de prise en pension | (1,13) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 1,42 | 7,89 |
| Agences du gouvernement américain | 7,63 | 5,28 |
| Obligations du Trésor américain | 3,94 | 3,51 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 4,56 | 12,44 |
| Titres adossés à des actifs | 8,81 | 10,28 |
| Émissions souveraines | 69,23 | 53,89 |
| Instruments à court terme | 0,80 | 1,18 |
| Fonds d'investissement | 4,12 | 4,49 |
| Contrats de mise en pension | 5,66 | 1,36 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,74 | (6,40) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | S/O | (0,09) |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,44 | (7,02) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,33 |
| Options vendues | | |
| Options de change | S/O | (0,04) |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,08) | (0,74) |
| Contrats de change à terme | 0,01 | 0,29 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (7,28) | 13,35 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Euro Short-Term Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | | | | | | | | |
| American Honda Finance Corp. 6,094 % éch. 22/11/2024 | \$ 500 | € 453 | 0,23 | Fédération des Caisses Desjardins du Québec 0,010 % éch. 08/04/2026 | € 900 | € 842 | 0,44 | 3,629 % éch. 06/04/2026 | € 1 700 | € 1 715 | 0,89 |
| American Tower Corp. 0,450 % éch. 15/01/2027 | € 600 | 549 | 0,28 | 2,000 % éch. 31/08/2026 | 900 | 878 | 0,45 | 4,800 % éch. 15/09/2025 | \$ 400 | 360 | 0,19 |
| 1,375 % éch. 04/04/2025 | 1 100 | 1 068 | 0,55 | Hamburg Commercial Bank AG 1,375 % éch. 27/05/2025 | 1 500 | 1 458 | 0,75 | 6,553 % éch. 14/09/2026 | 600 | 547 | 0,28 |
| ANZ New Zealand International Ltd. 0,895 % éch. 23/03/2027 | 1 000 | 939 | 0,49 | 5,560 % éch. 05/12/2025 | 600 | 600 | 0,31 | Toronto-Dominion Bank 0,864 % éch. 24/03/2027 | € 1 000 | 938 | 0,49 |
| AyT Cedula de Cajas Fondo de Titulizacion de Activos 3,750 % éch. 30/06/2025 | 1 100 | 1 104 | 0,57 | Hana Bank 0,010 % éch. 26/01/2026 | 1 000 | 937 | 0,48 | 3,250 % éch. 27/04/2026 | 900 | 905 | 0,47 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,125 % éch. 26/11/2025 | 919 | 898 | 0,46 | ING Bank Australia Ltd. 3,750 % éch. 04/05/2026 | 1 400 | 1 417 | 0,73 | UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,625 % éch. 15/02/2026 | 900 | 906 | 0,47 |
| 2,875 % éch. 16/07/2024 | 2 500 | 2 482 | 1,28 | 4,700 % éch. 08/12/2025 | AUD 2 400 | 1 484 | 0,77 | Vseobecná Uverova Banka A/S 3,500 % éch. 13/10/2026 | 900 | 908 | 0,47 |
| Banco BPM SpA 1,500 % éch. 02/12/2025 | 500 | 485 | 0,25 | 5,158 % éch. 26/05/2025 | 1 200 | 743 | 0,38 | Wells Fargo & Co. 1,338 % éch. 04/05/2025 | 1 470 | 1 455 | 0,75 |
| 3,875 % éch. 18/09/2026 | 900 | 917 | 0,47 | ING Groep NV 0,125 % éch. 29/11/2025 | € 300 | 290 | 0,15 | Westpac Securities NZ Ltd. 1,777 % éch. 14/01/2026 | 900 | 876 | 0,45 |
| Banco Santander S.A. 4,734 % éch. 21/11/2024 | 200 | 201 | 0,10 | JAB Holdings BV 1,750 % éch. 25/06/2026 | 700 | 675 | 0,35 | | | 87 660 | 45,29 |
| Banco Santander Totta S.A. 3,750 % éch. 11/09/2026 | 900 | 916 | 0,47 | Komerční Banka A/S 0,010 % éch. 20/01/2026 | 800 | 750 | 0,39 | INDUSTRIE | | | |
| Bank of America Corp. 4,962 % éch. 24/08/2025 | 1 600 | 1 607 | 0,83 | Kookmin Bank 2,375 % éch. 27/01/2026 | 1 000 | 984 | 0,51 | Burberry Group PLC 1,125 % éch. 21/09/2025 | £ 1 100 | 1 189 | 0,61 |
| Bank of Montreal 0,125 % éch. 26/01/2027 | 1 000 | 918 | 0,47 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % éch. 09/03/2026 | 600 | 574 | 0,30 | Carrier Global Corp. 4,375 % éch. 29/05/2025 | € 500 | 505 | 0,26 |
| 1,000 % éch. 05/04/2026 | 900 | 861 | 0,45 | 2,875 % éch. 29/05/2026 | 600 | 605 | 0,31 | Coca-Cola HBC Finance BV 1,000 % éch. 14/05/2027 | 400 | 375 | 0,19 |
| Bank of Nova Scotia 0,010 % éch. 14/01/2027 | 1 000 | 917 | 0,47 | Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,000 % éch. 24/02/2025 | \$ 1 200 | 1 050 | 0,54 | Comcast Corp. 0,250 % éch. 20/05/2027 | 400 | 367 | 0,19 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 5,720 % éch. 26/01/2025 | £ 1 200 | 1 382 | 0,71 | Liberty Mutual Finance Europe DAC 1,750 % éch. 27/03/2024 | € 1 600 | 1 590 | 0,82 | DH Europe Finance SARL 0,200 % éch. 18/03/2026 | 400 | 376 | 0,19 |
| Barclays PLC 3,375 % éch. 02/04/2025 | € 600 | 598 | 0,31 | Lloyds Bank PLC 0,125 % éch. 18/06/2026 | 900 | 841 | 0,44 | Eni SpA 3,625 % éch. 19/05/2027 | 300 | 305 | 0,16 |
| Bendigo & Adelaide Bank Ltd. 4,020 % éch. 04/10/2026 | 900 | 923 | 0,48 | Lloyds Banking Group PLC 0,500 % éch. 12/11/2025 | 900 | 874 | 0,45 | Haleon Netherlands Capital BV 1,250 % éch. 29/03/2026 | 700 | 672 | 0,35 |
| BNP Paribas S.A. 0,500 % éch. 15/07/2025 | 1 200 | 1 178 | 0,61 | 3,500 % éch. 01/04/2026 | 700 | 698 | 0,36 | Heineken NV 3,625 % éch. 15/11/2026 | 200 | 203 | 0,10 |
| BNZ International Funding Ltd. 0,625 % éch. 03/07/2025 | 2 700 | 2 595 | 1,34 | Lseg Netherlands BV 4,125 % éch. 29/09/2026 | 400 | 411 | 0,21 | JDE Peet's NV 0,000 % éch. 16/01/2026 (a) | 800 | 748 | 0,39 |
| CaixaBank S.A. 0,375 % éch. 03/02/2025 | 900 | 869 | 0,45 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 0,500 % éch. 01/10/2026 | 1 000 | 936 | 0,48 | Medtronic Global Holdings S.C.A. 1,125 % éch. 07/03/2027 | 400 | 378 | 0,20 |
| 4,625 % éch. 16/05/2027 | 700 | 715 | 0,37 | Mitsubishi HC Capital UK PLC 0,250 % éch. 03/02/2025 | 1 000 | 961 | 0,50 | Netflix, Inc. 3,625 % éch. 15/05/2027 | 700 | 710 | 0,37 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 0,010 % éch. 07/10/2026 | 1 000 | 923 | 0,48 | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,264 % éch. 14/06/2025 | 600 | 595 | 0,31 | Sandoz Finance BV 3,970 % éch. 17/04/2027 | 300 | 306 | 0,16 |
| 0,375 % éch. 10/03/2026 | 1 000 | 944 | 0,49 | 3,273 % éch. 19/09/2025 | 900 | 895 | 0,46 | Sartorius Finance BV 4,250 % éch. 14/09/2026 | 800 | 819 | 0,42 |
| 3,250 % éch. 31/03/2027 | 900 | 908 | 0,47 | National Australia Bank Ltd. 5,820 % éch. 17/06/2026 | £ 600 | 693 | 0,36 | Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % éch. 29/05/2026 | 1 200 | 1 138 | 0,59 |
| Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos 3,875 % éch. 23/05/2025 | 2 800 | 2 816 | 1,45 | National Bank of Canada 0,010 % éch. 29/09/2026 | € 1 000 | 926 | 0,48 | | | 8 091 | 4,18 |
| Cie de Financement Foncier S.A. 0,375 % éch. 09/04/2027 | 1 000 | 926 | 0,48 | 0,125 % éch. 27/01/2027 | 1 000 | 920 | 0,48 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | |
| Citigroup, Inc. 6,780 % éch. 24/05/2025 | \$ 1 700 | 1 543 | 0,80 | Nationwide Building Society 4,473 % éch. 10/11/2025 | 500 | 501 | 0,26 | BP Capital Markets PLC 1,573 % éch. 16/02/2027 | 400 | 382 | 0,20 |
| Clydesdale Bank PLC 0,010 % éch. 22/09/2026 | € 500 | 460 | 0,24 | 5,264 % éch. 10/11/2026 | \$ 900 | 830 | 0,43 | Cadent Finance PLC 0,625 % éch. 22/09/2024 | 500 | 488 | 0,25 |
| Commonwealth Bank of Australia 0,500 % éch. 27/07/2026 | 1 000 | 940 | 0,49 | NatWest Group PLC 0,750 % éch. 15/11/2025 | € 300 | 292 | 0,15 | EnBW International Finance BV 3,625 % éch. 22/11/2026 | 700 | 713 | 0,37 |
| 4,928 % éch. 09/12/2026 | \$ 2 600 | 2 360 | 1,22 | 7,472 % éch. 10/11/2026 | \$ 700 | 656 | 0,34 | Enel Finance International NV 0,000 % éch. 28/05/2026 (a) | 600 | 557 | 0,29 |
| Coventry Building Society 0,125 % éch. 20/06/2026 | € 1 000 | 932 | 0,48 | Nomura Holdings, Inc. 2,648 % éch. 16/01/2025 | 1 500 | 1 318 | 0,68 | Fortum Oyj 1,625 % éch. 27/02/2026 | 1 200 | 1 157 | 0,60 |
| Credit Agricole Italia SpA 0,625 % éch. 13/01/2026 | 900 | 857 | 0,44 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2024 | DKK 13 500 | 1 780 | 0,92 | GAS Networks Ireland 0,125 % éch. 04/12/2024 | 600 | 580 | 0,30 |
| Credit Suisse AG 5,185 % éch. 31/05/2024 | 1 600 | 1 606 | 0,83 | PKO Bank Hipoteczny S.A. 2,125 % éch. 25/06/2025 | € 1 000 | 981 | 0,51 | Orsted A/S 3,625 % éch. 01/03/2026 | 300 | 302 | 0,15 |
| Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025 | 700 | 701 | 0,36 | Prima Banka Slovensko A/S 4,250 % éch. 06/10/2025 | 900 | 913 | 0,47 | Verizon Communications, Inc. 0,875 % éch. 08/04/2027 | 400 | 374 | 0,19 |
| Deutsche Bank S.A. Espanola 3,625 % éch. 23/11/2026 | 500 | 509 | 0,26 | Royal Bank of Canada 0,010 % éch. 21/01/2027 | 1 000 | 917 | 0,47 | Vodafone Group PLC 0,900 % éch. 24/11/2026 | 400 | 380 | 0,20 |
| Deutsche Boerse AG 3,875 % éch. 28/09/2026 | 300 | 307 | 0,16 | 0,625 % éch. 23/03/2026 | 900 | 855 | 0,44 | | | 4 933 | 2,55 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 6,220 % éch. 26/04/2024 | £ 1 500 | 1 733 | 0,90 | Santander UK Group Holdings PLC 6,833 % éch. 21/11/2026 | \$ 400 | 369 | 0,19 | Total Obligations et billets privés | | 100 684 | 52,02 |
| DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Francfort-sur-le-Main | € 600 | 601 | 0,31 | Société Générale S.A. 1,125 % éch. 23/01/2025 | € 400 | 389 | 0,20 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| 4,637 % éch. 16/11/2026 | | | | Sparebanken Soer Boligkredit A/S 0,010 % éch. 26/10/2026 | 900 | 833 | 0,43 | Atlas Funding PLC 6,120 % éch. 25/07/2058 | £ 1 122 | 1 296 | 0,67 |
| | | | | Standard Chartered PLC 1,214 % éch. 23/03/2025 (c) | \$ 1 500 | 1 349 | 0,70 | Barley Hill PLC 6,118 % éch. 27/08/2058 | 382 | 439 | 0,23 |
| | | | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,267 % éch. 18/06/2026 | € 1 000 | 929 | 0,48 | | | | |
| | | | | 3,602 % éch. 16/02/2026 | 690 | 694 | 0,36 | | | | |
| | | | | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,550 % éch. 10/03/2025 | \$ 200 | 176 | 0,09 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEURDE (en milliers) | EN % L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEURDE (en milliers) | EN % L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEURDE (en milliers) | EN % L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------|--|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------|--|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------|
| Cheshire PLC | | | | Bavarian Sky UK PLC | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 6,120 % éch. 20/08/2045 | £ 637 | € 735 | 0,38 | 5,818 % éch. 20/04/2031 | £ 700 | € 810 | 0,42 | Cassa Depositi e Prestiti SpA | | | |
| Dilosk RMBS DAC | | | | Black Diamond CLO DAC | | | | 5,750 % éch. 05/05/2026 | \$ 800 | € 724 | 0,37 |
| 4,863 % éch. 20/07/2061 | € 763 | 765 | 0,39 | 4,853 % éch. 20/01/2032 | € 121 | 120 | 0,06 | État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie | | | |
| Domi BV | | | | BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | | 3,150 % éch. 20/11/2026 | € 600 | 610 | 0,32 |
| 4,775 % éch. 15/06/2051 | 90 | 90 | 0,05 | 4,615 % éch. 15/07/2030 | 494 | 491 | 0,25 | Ville de Paris | | | |
| 4,882 % éch. 15/11/2052 | 818 | 820 | 0,42 | BNPP AM Euro CLO DAC | | | | 0,010 % éch. 02/01/2024 | 600 | 600 | 0,31 |
| Dutch Property Finance BV | | | | 4,565 % éch. 15/04/2031 | 200 | 197 | 0,10 | | | 1 934 | 1,00 |
| 4,652 % éch. 28/04/2059 | 576 | 574 | 0,30 | Cairn CLO DAC | | | | | | | |
| 4,702 % éch. 28/10/2059 | 1 212 | 1 212 | 0,63 | 4,552 % éch. 30/04/2031 | 946 | 935 | 0,48 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| Eurosail PLC | | | | Cars Alliance Auto Loans Germany | | | | BILLETTS DE TRÉSORERIE | | | |
| 6,289 % éch. 13/06/2045 | £ 544 | 625 | 0,32 | 4,354 % éch. 18/03/2035 | 900 | 902 | 0,47 | Banco Santander S.A. | | | |
| Formentera Issuer PLC | | | | Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC | | | | 4,045 % éch. 06/06/2024 | 600 | 590 | 0,31 |
| 6,020 % éch. 28/07/2047 | 1 133 | 1 306 | 0,67 | 4,623 % éch. 15/12/2032 | 538 | 541 | 0,28 | Bayer AG | | | |
| Harbour Energy PLC | | | | Cumulus Static CLO DAC | | | | 4,279 % éch. 30/08/2024 | 800 | 780 | 0,40 |
| 6,020 % éch. 28/01/2054 | 489 | 565 | 0,29 | 5,499 % éch. 25/04/2033 | 300 | 300 | 0,16 | SGS Nederland Holding BV | | | |
| Hops Hill PLC | | | | CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | | 4,339 % éch. 15/01/2024 | 600 | 599 | 0,31 |
| 6,148 % éch. 27/05/2054 | 302 | 349 | 0,18 | Euro-Galaxy CLO DAC | | | | 4,339 % éch. 22/01/2024 | 600 | 599 | 0,31 |
| Kinbane DAC | | | | 4,652 % éch. 21/07/2030 | 533 | 527 | 0,27 | 4,481 % éch. 24/01/2024 | 600 | 598 | 0,31 |
| 4,685 % éch. 25/09/2062 | € 1 168 | 1 158 | 0,60 | Euro-Galaxy CLO DAC | | | | | | 3 166 | 1,64 |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC | | | | 4,693 % éch. 11/04/2031 | 518 | 513 | 0,27 | | | | |
| 6,320 % éch. 12/06/2057 | £ 459 | 531 | 0,27 | FCT CA Leasing | | | | BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILITÉ | | | |
| Mansard Mortgages PLC | | | | 4,736 % éch. 26/02/2042 | 480 | 481 | 0,25 | 3,873 % éch. | | | |
| 5,989 % éch. 15/12/2049 | 470 | 535 | 0,28 | Ginkgo Auto Loans | | | | 08/02/2024 (a)(b) | 110 | 110 | 0,06 |
| Mortimer BTL PLC | | | | 4,576 % éch. 25/07/2043 | 500 | 501 | 0,26 | BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS | | | |
| 0,000 % éch. 22/12/2056 | 500 | 578 | 0,30 | Ginkgo Personal Loans | | | | 3,859 % éch. | | | |
| Precise Mortgage Funding PLC | | | | 4,666 % éch. 23/09/2044 | 700 | 702 | 0,36 | 04/04/2024 (a)(b) | 640 | 634 | 0,33 |
| 6,126 % éch. 16/10/2056 | 28 | 33 | 0,02 | Ginkgo Sales Finance | | | | 3,867 % éch. | | | |
| Residential Mortgage Securities PLC | | | | 4,576 % éch. 25/11/2049 | 589 | 591 | 0,31 | 04/04/2024 (a)(b) | 2 780 | 2 754 | 1,42 |
| 6,470 % éch. 20/06/2070 | 54 | 62 | 0,03 | Harvest CLO DAC | | | | | | 3 388 | 1,75 |
| Rochester Financing PLC | | | | 4,566 % éch. 26/06/2030 | 1 059 | 1 047 | 0,54 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | |
| 5,920 % éch. 18/12/2044 | 640 | 733 | 0,38 | 4,695 % éch. 15/01/2031 | 782 | 776 | 0,40 | 10,900 % éch. | | | |
| Stanlington PLC | | | | Jubilee CLO DAC | | | | 04/01/2024 (a)(b) | HUF 132 000 | 345 | 0,18 |
| 6,170 % éch. 12/06/2045 | 715 | 825 | 0,43 | Man GLG Euro CLO DAC | | | | BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | |
| Stratton BTL Mortgage Funding PLC | | | | 4,645 % éch. 15/10/2030 | 536 | 533 | 0,28 | (0,238) % éch. | | | |
| 5,951 % éch. 20/01/2054 | 643 | 740 | 0,38 | 4,835 % éch. 15/01/2030 | 105 | 105 | 0,05 | 15/01/2024 (a)(b) | ¥ 92 000 | 591 | 0,30 |
| Stratton Mortgage Funding PLC | | | | OCP Euro CLO DAC | | | | (0,226) % éch. | | | |
| 5,920 % éch. 12/12/2043 | 303 | 347 | 0,18 | 4,785 % éch. 15/01/2032 | 601 | 598 | 0,31 | 15/01/2024 (a)(b) | 268 000 | 1 721 | 0,89 |
| 6,069 % éch. 25/09/2051 | 2 025 | 2 336 | 1,21 | OZLME DAC | | | | (0,217) % éch. | | | |
| Towd Point Mortgage Funding PLC | | | | 4,723 % éch. 24/08/2030 | 1 428 | 1 414 | 0,73 | 19/02/2024 (a)(b) | 531 000 | 3 410 | 1,76 |
| 5,891 % éch. 20/10/2051 | 1 700 | 1 955 | 1,01 | Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | (0,198) % éch. | | | |
| 6,365 % éch. 20/10/2051 | 656 | 758 | 0,39 | 0,000 % éch. 15/05/2033 | 500 | 499 | 0,26 | 19/02/2024 (a)(b) | 59 000 | 379 | 0,20 |
| 6,570 % éch. 20/05/2045 | 390 | 450 | 0,23 | 4,685 % éch. 15/10/2031 | 521 | 513 | 0,27 | (0,184) % éch. | | | |
| 6,571 % éch. 20/07/2045 | 572 | 662 | 0,34 | 4,695 % éch. 15/07/2031 | 710 | 702 | 0,36 | 11/03/2024 (a)(b) | 222 000 | 1 426 | 0,74 |
| 6,690 % éch. 20/02/2045 | 1 987 | 2 287 | 1,18 | 4,745 % éch. 15/04/2031 | 220 | 217 | 0,11 | (0,177) % éch. | | | |
| Tudor Rose Mortgages | | | | PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartement | | | | 11/03/2024 (a)(b) | 248 000 | 1 593 | 0,82 |
| 5,820 % éch. 20/06/2048 | 1 276 | 1 465 | 0,76 | 4,576 % éch. 26/11/2030 | 883 | 885 | 0,46 | | | 9 120 | 4,71 |
| Twin Bridges PLC | | | | Pony S.A. Compartement German Auto Loans | | | | BONS DU TRÉSOR SUISSE | | | |
| 6,432 % éch. 15/05/2056 | 500 | 578 | 0,30 | 4,502 % éch. 14/11/2032 | 500 | 501 | 0,26 | 1,625 % éch. | | | |
| | | 24 809 | 12,82 | Retail Automotive CP Germany UG | | | | 29/02/2024 (a)(b) | CHF 3 800 | 4 077 | 2,11 |
| | | | | 4,553 % éch. 21/07/2034 | 589 | 590 | 0,30 | 1,636 % éch. | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | Revocar UG | | | | 22/02/2024 (a)(b) | 800 | 859 | 0,44 |
| Accunia European CLO DAC | | | | 4,513 % éch. 21/04/2036 | 2 542 | 2 549 | 1,32 | | | 4 936 | 2,55 |
| 4,863 % éch. 20/01/2031 | € 2 924 | 2 897 | 1,50 | Silver Arrow S.A. | | | | Total des Instruments à court terme | | 21 065 | 10,89 |
| 4,895 % éch. 15/10/2030 | 202 | 202 | 0,10 | 4,273 % éch. 15/02/2030 | 520 | 521 | 0,27 | Total des Valeurs mobilières | € 174 163 | 89,99 | |
| Asset-Backed European Securitisation Transaction | | | | 4,313 % éch. 15/09/2030 | 472 | 473 | 0,24 | | | | |
| Twenty-One BV | | | | Toro European CLO DAC | | | | | | | |
| 4,553 % éch. 21/09/2031 | 471 | 472 | 0,24 | 4,705 % éch. 15/10/2030 | 371 | 368 | 0,19 | | | | |
| Autonorica FCT | | | | Willow Park CLO DAC | | | | | | | |
| 4,346 % éch. 26/01/2043 | 719 | 719 | 0,37 | 4,805 % éch. 15/01/2031 | 800 | 796 | 0,41 | | | | |
| Bavarian Sky S.A. | | | | | | 25 671 | 13,26 | | | | |
| 4,269 % éch. 20/03/2030 | 588 | 589 | 0,30 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--|-------------------|--|--|---------------------|
| BPS | 3,650 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | € 12 400 | Bpifrance SACA 3,000 % éch. 10/09/2026 | € (12 736) | € 12 400 | € 12 405 | 6,41 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | € (12 736) | € 12 400 | € 12 405 | 6,41 |

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Euro Short-Term Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Court | 09/2025 | 78 | € (61) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Long | 09/2026 | 78 | 48 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 118 | (221) | (0,11) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 430 | (290) | (0,15) |
| | | | | € (524) | (0,27) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | € (524) | (0,27) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 1 000 | € 0 | 0,00 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | € 0 | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | ¥ 740 000 | € 4 774 | € 16 | € 0 | € 16 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | AUD 3 408 | € 2 056 | 0 | (49) | (49) | (0,03) |
| | 01/2024 | CHF 3 835 | € 4 022 | 0 | (104) | (104) | (0,05) |
| | 01/2024 | € 643 | \$ 702 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 410 | € 476 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 18 239 | \$ 52 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 219 | € 200 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 2 HUF | 819 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 887 | £ 769 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 126 | € 145 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | \$ 377 | 341 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF 673 | 701 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 3 152 | \$ 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | \$ 30 | CAD 41 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | € 885 | ¥ 142 940 | 33 | 0 | 33 | 0,02 |
| JPM | 01/2024 | HUF 89 152 | \$ 254 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 679 | £ 582 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 21 822 | \$ 62 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 75 200 | € 479 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 14 178 | 12 895 | 64 | 0 | 64 | 0,03 |
| | 10/2024 | DKK 13 040 | 1 755 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RBC | 01/2024 | € 2 402 | ¥ 380 000 | 41 | 0 | 41 | 0,02 |
| SCX | 01/2024 | £ 23 845 | € 27 464 | 0 | (49) | (49) | (0,03) |
| UAG | 01/2024 | € 241 | £ 208 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 590 000 | € 3 698 | 0 | (112) | (112) | (0,05) |
| | 03/2024 | 470 000 | 2 944 | 0 | (97) | (97) | (0,05) |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | € 160 | € (459) | € (299) | (0,15) |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

Total des Investissements

Autres actifs et passifs à court terme

Actifs nets

€ (299) (0,15)

€ 185 740 95,98

€ 7 774 4,02

€ 193 514 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
 (b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
 (c) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,48 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|---------|--------------|---------------------|
| Standard Chartered PLC | 1,214 % | 23/03/2025 | 24/10/2022 | € 1 455 | € 1 349 | 0,70 |

Un montant en numéraire de 1 368 € (31 décembre 2022 : 6 376 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 260 € (31 décembre 2022 : 20 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 174 163 | € 0 | € 174 163 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 12 400 | 0 | 12 400 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (524) | (299) | 0 | (823) |
| Totaux | € (524) | € 186 264 | € 0 | € 185 740 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 330 698 | € 0 | € 330 698 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 14 100 | 0 | 14 100 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 2 474 | 623 | 0 | 3 097 |
| Totaux | € 2 474 | € 345 421 | € 0 | € 347 895 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | € 16 | € 0 | € 16 | € 57 | € 0 | € 57 |
| BPS | (158) | 0 | (158) | (9) | 0 | (9) |
| BRC | S/O | S/O | S/O | (9) | 0 | (9) |
| CBK | (23) | 0 | (23) | 77 | 0 | 77 |
| DUB | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 33 | 0 | 33 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (3) | 0 | (3) | 31 | 0 | 31 |
| MBC | 53 | 0 | 53 | 371 | (230) | 141 |
| MY1 | S/O | S/O | S/O | (25) | 0 | (25) |
| RBC | 41 | 0 | 41 | (190) | 20 | (170) |
| SCX | (49) | 0 | (49) | 1 972 | (1 890) | 82 |
| UAG | (210) | 260 | 50 | (51) | 0 | (51) |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû/de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 84,63 | 82,88 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 5,05 | 10,78 |
| Autres valeurs mobilières | 0,31 | S/O |
| Contrats de mise en pension | 6,41 | 3,99 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,27) | 0,70 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,00 | (0,45) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,15) | 0,63 |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|-----------------------------|-----------------------------|
| Obligations et billets privés | 52,02 | 56,35 |
| Agences du gouvernement américain | S/O | 1,90 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 12,82 | 14,24 |
| Titres adossés à des actifs | 13,26 | 6,88 |
| Émissions souveraines | 1,00 | 3,88 |
| Instruments à court terme | 10,89 | 10,41 |
| Contrats de mise en pension | 6,41 | 3,99 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,27) | 0,70 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines | | |
| - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | S/O | (0,45) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Contrats de change à terme | (0,15) | 0,63 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 4,02 | 1,47 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | ITALIE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| AUTRICHE | | | | Ubisoft Entertainment S.A. | | | | 0,878 % éch. 24/11/2027 € 2 100 € 1 793 0,49 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Unibail-Rodamco-Westfield SE | | | | 7,250 % éch. 03/07/2028 (e) 900 903 0,25 | | | |
| ams-OSRAM AG | | | | Vallourec SACA | | | | 8,500 % éch. 30/06/2026 750 756 0,21 | | | |
| 10,500 % éch. 30/03/2029 € 1 600 € 1 741 0,47 | | | | Total France | | | | 42 102 11,44 | | | |
| Erste Group Bank AG | | | | ALLEMAGNE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 4,250 % éch. 15/10/2027 (e)(g) 600 515 0,14 | | | | Bayer AG | | | | 7,000 % éch. 25/09/2083 2 500 2 587 0,70 | | | |
| Total Autriche | | | | Cheplapharm Arzneimittel GmbH | | | | 3,500 % éch. 11/02/2027 800 776 0,21 | | | |
| 2 256 0,61 | | | | 5,500 % éch. 15/01/2028 | | | | \$ 700 600 0,16 | | | |
| BELGIQUE | | | | 7,500 % éch. 15/05/2030 | | | | € 1 400 1 495 0,41 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Clearstream Banking AG | | | | 0,000 % éch. 01/12/2025 (c) 100 95 0,02 | | | |
| KBC Group NV | | | | Commerzbank AG | | | | 4,000 % éch. 05/12/2030 2 000 1 968 0,53 | | | |
| 8,000 % éch. 05/09/2028 (e)(g) 800 851 0,23 | | | | 6,500 % éch. 06/12/2032 | | | | 100 106 0,03 | | | |
| Ontex Group NV | | | | 8,625 % éch. 28/02/2033 | | | | £ 1 300 1 598 0,43 | | | |
| 3,500 % éch. 15/07/2026 2 200 2 128 0,58 | | | | CT Investment GmbH | | | | 5,500 % éch. 15/04/2026 € 800 797 0,22 | | | |
| Total Belgique | | | | Ctec GmbH | | | | 5,250 % éch. 15/02/2030 100 90 0,02 | | | |
| 2 979 0,81 | | | | Deutsche Bank AG | | | | 5,625 % éch. 19/05/2031 500 507 0,14 | | | |
| CHINE | | | | 7,079 % éch. 10/02/2034 | | | | \$ 300 279 0,08 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Douglas GmbH | | | | 6,000 % éch. 08/04/2026 € 2 300 2 280 0,62 | | | |
| Yango Justice International Ltd. | | | | IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % en numéraire ou | | | | 4,625 % de rémunération en nature) | | | |
| 8,250 % éch. 25/11/2023 ^ \$ 300 2 0,00 | | | | 3,875 % éch. 15/05/2027 (b) | | | | 1 300 1 277 0,35 | | | |
| RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | | IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % en numéraire ou | | | | 7,125 % de rémunération en nature) | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,375 % éch. 15/05/2029 (b) | | | | \$ 1 100 978 0,26 | | | |
| EP Infrastructure A/S | | | | IHO Verwaltungs GmbH (8,750 % en numéraire ou | | | | 9,500 % de rémunération en nature) | | | |
| 1,816 % éch. 02/03/2031 € 4 300 3 338 0,91 | | | | 8,750 % éch. 15/05/2028 (b) | | | | € 500 546 0,15 | | | |
| FRANCE | | | | Nidda Healthcare Holding GmbH | | | | 7,500 % éch. 21/08/2026 2 800 2 891 0,79 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | PrestigeBidCo GmbH | | | | 9,965 % éch. 15/07/2027 500 509 0,14 | | | |
| Accor S.A. | | | | ProGroup AG | | | | 3,000 % éch. 31/03/2026 2 100 2 047 0,56 | | | |
| 7,250 % éch. 11/01/2029 (e) 700 763 0,21 | | | | Schaeffler AG | | | | 3,375 % éch. 12/10/2028 2 300 2 234 0,61 | | | |
| Altarea S.C.A. | | | | TK Elevator Holdco GmbH | | | | 6,625 % éch. 15/07/2028 900 834 0,23 | | | |
| 1,875 % éch. 17/01/2028 2 200 1 854 0,50 | | | | TK Elevator Midco GmbH | | | | 4,375 % éch. 15/07/2027 2 100 2 037 0,55 | | | |
| Altice France S.A. | | | | ZF Finance GmbH | | | | 2,000 % éch. 06/05/2027 700 649 0,18 | | | |
| 2,125 % éch. 15/02/2025 1 200 1 160 0,32 | | | | 2,250 % éch. 03/05/2028 | | | | 500 460 0,12 | | | |
| 2,500 % éch. 15/01/2025 500 483 0,13 | | | | 2,750 % éch. 25/05/2027 | | | | 2 700 2 576 0,70 | | | |
| 3,375 % éch. 15/01/2028 1 400 1 115 0,30 | | | | 5,750 % éch. 03/08/2026 | | | | 200 207 0,06 | | | |
| 4,125 % éch. 15/01/2029 1 200 963 0,26 | | | | Total Allemagne | | | | 30 423 8,27 | | | |
| 4,250 % éch. 15/10/2029 1 000 799 0,22 | | | | IRLANDE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 5,875 % éch. 01/02/2027 700 626 0,17 | | | | AIB Group PLC | | | | 6,250 % éch. 23/06/2025 (e)(g) 900 894 0,24 | | | |
| 11,500 % éch. 01/02/2027 (a)(h) 1 500 1 511 0,41 | | | | Bank of Ireland Group PLC | | | | 6,750 % éch. 01/03/2033 200 216 0,06 | | | |
| BNP Paribas S.A. | | | | 7,594 % éch. 06/12/2032 | | | | £ 600 723 0,20 | | | |
| 7,750 % éch. 16/08/2029 (e)(g) \$ 900 834 0,23 | | | | James Hardie International Finance DAC | | | | 3,625 % éch. 01/10/2026 € 200 198 0,05 | | | |
| 8,500 % éch. 14/08/2028 (e)(g) 500 475 0,13 | | | | Permanent TSB Group Holdings PLC | | | | 3,000 % éch. 19/08/2031 1 200 1 136 0,31 | | | |
| CAB SELAS | | | | Total Irlande | | | | 3 167 0,86 | | | |
| 3,375 % éch. 01/02/2028 € 1 900 1 698 0,46 | | | | ISRAËL | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Cerba Healthcare SACA | | | | Energian Israel Finance Ltd. | | | | 8,500 % éch. 30/09/2033 \$ 2 000 1 736 0,47 | | | |
| 3,500 % éch. 31/05/2028 2 400 2 016 0,55 | | | | | | | | | | | |
| Crown European Holdings S.A. | | | | | | | | | | | |
| 4,750 % éch. 15/03/2029 1 300 1 327 0,36 | | | | | | | | | | | |
| Électricité de France S.A. | | | | | | | | | | | |
| 2,625 % éch. 01/12/2027 (e) 1 000 892 0,24 | | | | | | | | | | | |
| 2,875 % éch. 15/12/2026 (e) 3 600 3 347 0,91 | | | | | | | | | | | |
| 3,000 % éch. 03/09/2027 (e) 1 400 1 280 0,35 | | | | | | | | | | | |
| 3,375 % éch. 15/06/2030 (e) 1 000 880 0,24 | | | | | | | | | | | |
| 4,000 % éch. 04/07/2024 (e) 600 596 0,16 | | | | | | | | | | | |
| 5,875 % éch. 22/01/2029 (e) £ 100 106 0,03 | | | | | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 29/01/2026 (e) 2 200 2 479 0,67 | | | | | | | | | | | |
| 9,125 % éch. 15/03/2033 (e) \$ 200 203 0,05 | | | | | | | | | | | |
| ELO SACA | | | | | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 22/03/2029 € 300 305 0,08 | | | | | | | | | | | |
| Eramet S.A. | | | | | | | | | | | |
| 7,000 % éch. 22/05/2028 1 300 1 331 0,36 | | | | | | | | | | | |
| Forvia SE | | | | | | | | | | | |
| 2,750 % éch. 15/02/2027 4 400 4 223 1,14 | | | | | | | | | | | |
| Illiad S.A. | | | | | | | | | | | |
| 5,375 % éch. 14/06/2027 2 700 2 780 0,76 | | | | | | | | | | | |
| 5,375 % éch. 15/02/2029 1 400 1 440 0,39 | | | | | | | | | | | |
| Loxam S.A.S. | | | | | | | | | | | |
| 2,875 % éch. 15/04/2026 500 486 0,13 | | | | | | | | | | | |
| 4,500 % éch. 15/02/2027 200 200 0,05 | | | | | | | | | | | |
| 4,500 % éch. 15/04/2027 300 286 0,08 | | | | | | | | | | | |
| 6,375 % éch. 15/05/2028 2 100 2 192 0,60 | | | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|
| Cirsa Finance International SARL | | | | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV | | | | SUISSE | | | |
| 4,500 % éch. 15/03/2027 | € 4 100 | € 3 958 | 1,08 | 1,875 % éch. 31/03/2027 | € 6 200 | € 5 658 | 1,54 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 8,448 % éch. 31/07/2028 | 250 | 254 | 0,07 | 3,750 % éch. 09/05/2027 | 100 | 97 | 0,03 | UBS Group AG | | | |
| CPI Property Group S.A. | | | | 7,375 % éch. 15/09/2029 | 1 300 | 1 426 | 0,39 | 6,442 % éch. 11/08/2028 | \$ 1 550 | € 1 458 | 0,40 |
| 4,875 % éch. 16/07/2025 (e) | 300 | 89 | 0,02 | United Group BV | | | | 9,016 % éch. 15/11/2033 | 600 | 668 | 0,18 |
| 4,875 % éch. 18/08/2026 (e) | 300 | 90 | 0,02 | 3,625 % éch. 15/02/2028 | 800 | 744 | 0,20 | 9,250 % éch. 13/11/2028 (e)(g) | 250 | 245 | 0,07 |
| Ephios Subco SARL | | | | 4,000 % éch. 15/11/2027 | 1 200 | 1 139 | 0,31 | Total Suisse | | 2 371 | 0,65 |
| 7,875 % éch. 31/01/2031 | 900 | 933 | 0,25 | Wintershall Dea Finance BV | | | | ROYAUME-UNI | | | |
| InPost S.A. | | | | 2,499 % éch. 20/04/2026 (e) | 4 100 | 3 733 | 1,01 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 2,250 % éch. 15/07/2027 | 700 | 652 | 0,18 | ZF Europe Finance BV | | | | Barclays PLC | | | |
| LHMC Finco 2 SARL (7,250 % en numéraire ou 8,000 % de rémunération en nature) | | | | 2,000 % éch. 23/02/2026 | 500 | 478 | 0,13 | 8,875 % éch. 15/09/2027 (e)(g) | £ 600 | 692 | 0,19 |
| 7,250 % éch. 02/10/2025 (b) | 416 | 414 | 0,11 | 3,000 % éch. 23/10/2029 | 100 | 92 | 0,02 | 9,625 % éch. 15/12/2029 (e)(g) | \$ 600 | 566 | 0,15 |
| Loarre Investments SARL | | | | 6,125 % éch. 13/03/2029 | 1 400 | 1 492 | 0,40 | BCP Modular Services Finance PLC | | | |
| 6,500 % éch. 15/05/2029 | 2 400 | 2 371 | 0,64 | Ziggo BV | | | | 4,750 % éch. 30/11/2028 | € 2 000 | 1 863 | 0,51 |
| Logicor Financing SARL | | | | 4,875 % éch. 15/01/2030 | \$ 400 | 323 | 0,09 | 6,750 % éch. 30/11/2029 | 500 | 413 | 0,11 |
| 0,625 % éch. 17/11/2025 | 200 | 187 | 0,05 | | | 33 933 | 9,22 | Bellis Acquisition Co. PLC | | | |
| 2,250 % éch. 13/05/2025 | 2 400 | 2 326 | 0,63 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | 3,250 % éch. 16/02/2026 | £ 3 100 | 3 329 | 0,90 |
| Monitchem HoldCo S.A. | | | | Nouryon Finance BV | | | | Burford Capital PLC | | | |
| 8,750 % éch. 01/05/2028 | 400 | 410 | 0,11 | 8,182 % éch. 03/04/2028 | € 944 | 947 | 0,26 | 5,000 % éch. 01/12/2026 | 1 500 | 1 625 | 0,44 |
| PLT Finance SARL | | | | Total Pays-Bas | | 34 880 | 9,48 | Deuce Finco PLC | | | |
| 4,625 % éch. 05/01/2026 | 1 400 | 1 396 | 0,38 | NORVÈGE | | | | 5,500 % éch. 15/06/2027 | 1 600 | 1 727 | 0,47 |
| Stena International S.A. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Gatwick Airport Finance PLC | | | |
| 3,750 % éch. 01/02/2025 | 400 | 399 | 0,11 | Var Energi ASA | | | | 4,375 % éch. 07/04/2026 | 3 200 | 3 550 | 0,96 |
| Summer BC Holdco SARL | | | | 7,862 % éch. 15/11/2083 | 1 700 | 1 815 | 0,49 | Harbour Energy PLC | | | |
| 5,750 % éch. 31/10/2026 | 750 | 721 | 0,20 | PANAMA | | | | 5,500 % éch. 15/10/2026 | \$ 1 400 | 1 240 | 0,34 |
| Telecom Italia Capital S.A. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Heathrow Finance PLC | | | |
| 6,375 % éch. 15/11/2033 | \$ 700 | 621 | 0,17 | Carnival Corp. | | | | 3,875 % éch. 01/03/2027 | £ 400 | 427 | 0,12 |
| Trafigura Funding S.A. | | | | 7,000 % éch. 15/08/2029 | \$ 100 | 95 | 0,03 | 4,125 % éch. 01/09/2029 | 1 214 | 1 215 | 0,33 |
| 3,875 % éch. 02/02/2026 | € 700 | 669 | 0,18 | ESPAGNE | | | | Iceland Bondco PLC | | | |
| | | 21 434 | 5,83 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,375 % éch. 15/05/2028 | 100 | 97 | 0,03 |
| Total Luxembourg | | 21 457 | 5,84 | Aedas Homes Opco SLU | | | | INEOS Finance PLC | | | |
| MULTINATIONALES | | | | 4,000 % éch. 15/08/2026 | € 700 | 663 | 0,18 | 2,125 % éch. 15/11/2025 | € 500 | 485 | 0,13 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Banco Santander S.A. | | | | 2,875 % éch. 01/05/2026 | 900 | 874 | 0,24 |
| Ardagh Packaging Finance PLC | | | | 4,375 % éch. 14/01/2026 (e)(g) | 800 | 738 | 0,20 | INEOS Quattro Finance PLC | | | |
| 2,125 % éch. 15/08/2026 | 2 800 | 2 504 | 0,68 | CaixaBank S.A. | | | | 2,500 % éch. 15/01/2026 | 2 600 | 2 525 | 0,69 |
| Clarios Global LP | | | | 5,875 % éch. 09/10/2027 (e)(g) | 600 | 583 | 0,16 | 8,500 % éch. 15/03/2029 | 200 | 212 | 0,06 |
| 4,375 % éch. 15/05/2026 | 900 | 896 | 0,24 | Cellnex Finance Co. S.A. | | | | John Lewis PLC | | | |
| Total Multinationales | | 3 400 | 0,92 | 2,000 % éch. 15/09/2032 | 800 | 686 | 0,18 | 4,250 % éch. 18/12/2034 | £ 540 | 453 | 0,12 |
| PAYS-BAS | | | | Grifols S.A. | | | | 6,125 % éch. 21/01/2025 | 400 | 461 | 0,12 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,250 % éch. 15/11/2027 | 300 | 283 | 0,08 | Lloyds Banking Group PLC | | | |
| ABN AMRO Bank NV | | | | 3,200 % éch. 01/05/2025 | 3 600 | 3 532 | 0,96 | 4,947 % éch. 27/06/2025 (e)(g) | € 700 | 684 | 0,19 |
| 4,750 % éch. 22/09/2027 (e)(g) | 700 | 641 | 0,17 | 3,875 % éch. 15/10/2028 | 1 600 | 1 466 | 0,40 | 7,500 % éch. 27/09/2025 (e)(g) | \$ 600 | 533 | 0,14 |
| Boels Topholding BV | | | | Grupo Antolin-Irausa S.A. | | | | Market Bidco Finco PLC | | | |
| 6,250 % éch. 15/02/2029 | 900 | 943 | 0,26 | 3,500 % éch. 30/04/2028 | 1 700 | 1 300 | 0,35 | 4,750 % éch. 04/11/2027 | € 1 300 | 1 169 | 0,32 |
| Citycon Treasury BV | | | | Lorca Telecom Bondco S.A. | | | | 5,500 % éch. 04/11/2027 | £ 1 500 | 1 530 | 0,42 |
| 1,250 % éch. 08/09/2026 (i) | 2 300 | 2 012 | 0,55 | 4,000 % éch. 18/09/2027 | 1 800 | 1 762 | 0,48 | Pinnacle Bidco PLC | | | |
| Cooperatieve Rabobank UA | | | | Total Espagne | | 11 013 | 2,99 | 8,250 % éch. 11/10/2028 | € 1 700 | 1 772 | 0,48 |
| 4,875 % éch. 29/06/2029 (e)(g) | 600 | 543 | 0,15 | SUÈDE | | | | 10,000 % éch. 11/10/2028 | £ 1 500 | 1 804 | 0,49 |
| CTP NV | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | SIG PLC | | | |
| 0,500 % éch. 21/06/2025 | 1 600 | 1 509 | 0,41 | Akelius Residential Property AB | | | | 5,250 % éch. 30/11/2026 | € 200 | 181 | 0,05 |
| Dufry One BV | | | | 2,249 % éch. 17/05/2081 | 1 300 | 1 098 | 0,30 | Thames Water Kemble Finance PLC | | | |
| 2,000 % éch. 15/02/2027 | 1 800 | 1 688 | 0,46 | Castellum AB | | | | 4,625 % éch. 19/05/2026 | £ 300 | 177 | 0,05 |
| 3,625 % éch. 15/04/2026 | CHF 1 700 | 1 822 | 0,49 | 3,125 % éch. 02/12/2026 (e) | 1 600 | 1 221 | 0,33 | Travis Perkins PLC | | | |
| Energizer Gamma Acquisition BV | | | | Dometic Group AB | | | | 3,750 % éch. 17/02/2026 | 700 | 763 | 0,21 |
| 3,500 % éch. 30/06/2029 | € 1 700 | 1 471 | 0,40 | 2,000 % éch. 29/09/2028 | 900 | 790 | 0,21 | Virgin Media Secured Finance PLC | | | |
| GTCR W-2 Merger Sub LLC | | | | 3,000 % éch. 08/05/2026 | 500 | 493 | 0,13 | 4,250 % éch. 15/01/2030 | 5 000 | 5 060 | 1,38 |
| 8,500 % éch. 15/01/2031 | £ 2 200 | 2 753 | 0,75 | Intrum AB | | | | Vmed O2 UK Financing PLC | | | |
| ING Groep NV | | | | 4,875 % éch. 15/08/2025 | 1 400 | 1 313 | 0,36 | 3,250 % éch. 31/01/2031 | € 700 | 646 | 0,17 |
| 3,875 % éch. 16/05/2027 (e)(g) | \$ 700 | 516 | 0,14 | 9,250 % éch. 15/03/2028 (i) | 1 700 | 1 560 | 0,42 | 4,000 % éch. 31/01/2029 | £ 1 600 | 1 641 | 0,45 |
| IPD BV | | | | Verisure Holding AB | | | | 4,250 % éch. 31/01/2031 | \$ 200 | 158 | 0,04 |
| 8,000 % éch. 15/06/2028 | € 1 300 | 1 392 | 0,38 | 3,250 % éch. 15/02/2027 | 3 600 | 3 466 | 0,94 | Zenith Finco PLC | | | |
| OI European Group BV | | | | 3,875 % éch. 15/07/2026 | 2 000 | 1 969 | 0,54 | 6,500 % éch. 30/06/2027 | £ 800 | 754 | 0,20 |
| 6,250 % éch. 15/05/2028 | 1 100 | 1 155 | 0,31 | Verisure Midholding AB | | | | | | 38 626 | 10,50 |
| Q-Park Holding BV | | | | 5,250 % éch. 15/02/2029 | 600 | 574 | 0,16 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | |
| 3,500 % éch. 01/02/2025 | 1 200 | 1 161 | 0,32 | Total Suède | | 12 484 | 3,39 | Lorca Holdco Ltd. | | | |
| Sagax Euro MTN NL BV | | | | | | | | 7,604 % éch. 17/09/2027 | € 2 300 | 2 295 | 0,63 |
| 1,000 % éch. 17/05/2029 | 100 | 82 | 0,02 | ÉTATS-UNIS | | | | Total Royaume-Uni | | 40 921 | 11,13 |
| Sigma Holdco BV | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | American Airlines Pass-Through Trust | | | |
| 5,750 % éch. 15/05/2026 | 900 | 810 | 0,22 | American Airlines Pass-Through Trust | | | | 3,375 % éch. 01/11/2028 | \$ 892 | 740 | 0,20 |
| Summer BidCo BV (9,000 % en numéraire ou 9,750 % de rémunération en nature) | | | | 3,700 % éch. 01/04/2028 | | | | | 1 740 | 1 467 | 0,40 |
| 9,000 % éch. 15/11/2025 (b) | 254 | 253 | 0,07 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|---|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|--------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. 2,875 % éch. 02/03/2025 (e) | € 4 100 | € 3 950 | 1,07 | Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % éch. 01/10/2028 | € 2 900 | € 2 666 | 0,73 | 3,867 % éch. 08/02/2024 (c)(d) | € 300 | € 299 | 0,08 |
| Avantor Funding, Inc. 3,875 % éch. 15/07/2028 | 900 | 884 | 0,24 | Organon & Co. 2,875 % éch. 30/04/2028 | 2 000 | 1 842 | 0,50 | 3,869 % éch. 08/02/2024 (c)(d) | 2 940 | 2 929 | 0,80 |
| Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % éch. 02/10/2025 | 600 | 601 | 0,16 | Rio Oil Finance Trust 8,200 % éch. 06/04/2028 | \$ 1 275 | 1 183 | 0,32 | | | | |
| Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % éch. 01/07/2031 | \$ 300 | 289 | 0,08 | SCIL LLC 9,500 % éch. 15/07/2028 (i) | € 600 | 641 | 0,18 | BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS | | | |
| Chemours Co. 4,000 % éch. 15/05/2026 | € 1 600 | 1 580 | 0,43 | Spectrum Brands, Inc. 4,000 % éch. 01/10/2026 | 2 600 | 2 573 | 0,70 | 3,816 % éch. 04/01/2024 (c)(d) | 800 | 800 | 0,22 |
| Coty, Inc. 3,875 % éch. 15/04/2026 | 2 100 | 2 101 | 0,57 | Standard Industries, Inc. 2,250 % éch. 21/11/2026 | 3 300 | 3 131 | 0,85 | 3,818 % éch. 04/01/2024 (c)(d) | 2 010 | 2 010 | 0,55 |
| Credit Suisse AG AT1 Claim | \$ 800 | 87 | 0,02 | UGI International LLC 2,500 % éch. 01/12/2029 | 1 400 | 1 196 | 0,33 | 3,823 % éch. 04/01/2024 (c)(d) | 1 280 | 1 280 | 0,35 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % éch. 17/06/2031 | 1 700 | 1 328 | 0,36 | Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028 | \$ 900 | 824 | 0,22 | 3,853 % éch. 04/04/2024 (c)(d) | 500 | 495 | 0,13 |
| Freedom Mortgage Corp. 12,000 % éch. 01/10/2028 | 1 100 | 1 088 | 0,30 | 8,375 % éch. 01/06/2031 | 900 | 815 | 0,22 | 3,854 % éch. 14/02/2024 (c)(d) | 300 | 299 | 0,08 |
| Gap, Inc. 3,875 % éch. 01/10/2031 | 900 | 672 | 0,18 | WMG Acquisition Corp. 2,250 % éch. 15/08/2031 | € 1 500 | 1 320 | 0,36 | 3,867 % éch. 04/04/2024 (c)(d) | 940 | 931 | 0,25 |
| Graphic Packaging International LLC 2,625 % éch. 01/02/2029 | € 200 | 186 | 0,05 | Total États-Unis | | 33 438 | 9,09 | | | | |
| IQVIA, Inc. 2,250 % éch. 15/03/2029 | 800 | 735 | 0,20 | | | | | | | | |
| Kronos International, Inc. 3,750 % éch. 15/09/2025 | 1 600 | 1 539 | 0,42 | | | | | | | | |

| ACTIONS | | | |
|--|-----------------|-------------|------|
| FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f) | 184 900 | 18 291 | 4,97 |
| Total des Fonds d'investissement | € 18 291 | 4,97 | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|-------------------|--|--|---------------------|
| BPS | 3,500 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | € 30 300 | Obligation internationale du gouvernement belge 0,650 % éch. 22/06/2071 | € (29 918) | € 30 300 | € 30 312 | 8,24 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | € (29 918) | € 30 300 | € 30 312 | 8,24 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NEGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Long | 03/2024 | 165 | € 319 | 0,09 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 | 0 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 1 | 11 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Long | 03/2024 | 591 | 384 | 0,11 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 20 | (38) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 136 | (327) | (0,09) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 29 | (135) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 27 | 218 | 0,06 |
| | | | | € 432 | 0,12 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | € 432 | 0,12 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Cellnex Telecom S.A. | 5,000 % | 20/12/2030 | € 4 400 | € 212 | 0,05 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20/12/2027 | 100 | 22 | 0,01 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20/06/2028 | 1 000 | 70 | 0,02 |
| United Group BV | 5,000 | 20/12/2027 | 700 | 177 | 0,05 |
| | | | | € 481 | 0,13 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/12/2028 | € 35 300 | € 1 600 | 0,44 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 400 | € (71) | (0,02) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 1 500 | (99) | (0,03) |
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 4 400 | 70 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2025 | \$ 3 800 | 317 | 0,09 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2030 | 3 000 | 447 | 0,12 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2027 | 800 | 22 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 1 300 | (17) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 1 300 | (15) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 1 300 | (15) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 400 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 1 300 | (13) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 1 300 | (13) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 1 300 | (13) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | € 1 500 | 53 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 200 | (21) | (0,01) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 11 200 | 476 | 0,13 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 1 100 | 15 | 0,00 |
| | | | | | € 1 119 | 0,30 |
| | | | | | € 3 200 | 0,87 |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 % | 08/04/2024 | 100 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | € (1) | € (1) | 0,00 |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS | Deutsche Bank AG | 1,000 % | 20/06/2027 | € 600 | € (81) | € 69 | € (12) | 0,00 |
| GST | EP Infrastructure A/S | 5,000 | 20/06/2028 | 600 | (12) | 70 | 58 | 0,01 |
| | | | | | € (93) | € 139 | € 46 | 0,01 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | € 373 | £ 321 | € 0 | € (2) | € (2) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 866 | \$ 945 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 1 252 | € 1 453 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 457 | 416 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CHF 1 517 | 1 577 | 0 | (55) | (55) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 264 | 241 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 28 521 | 25 944 | 131 | 0 | 131 | 0,05 |
| SCX | 01/2024 | £ 30 513 | 35 144 | 0 | (62) | (62) | (0,02) |
| | | | | € 144 | € (130) | € 14 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | € 59 | 0,02 |
| Total des Investissements | | | | | | € 358 543 | 97,49 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | € 9 224 | 2,51 |
| Actifs nets | | | | | | € 367 767 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

- (a) Titre vendu avant l'émission.
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Titre à coupon zéro.
- (d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : néant) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------|-----------------|--------------|---------|--------------|---------------------|
| Altice France S.A. | 11,500 % | 01/02/2027 | 20/12/2023 | € 1 455 | € 1 511 | 0,41 |

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 1 895 € (31 décembre 2022 : 0 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 9 183 € (31 décembre 2022 : 2 986 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 20 € (31 décembre 2022 : 0 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| | Valeurs mobilières | € 0 | € 306 261 | |
| Fonds d'investissement | 18 291 | 0 | 0 | 18 291 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 30 300 | 0 | 30 300 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 932 | 2 759 | 0 | 3 691 |
| Totaux | € 19 223 | € 339 320 | € 0 | € 358 543 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| | Valeurs mobilières | € 0 | € 157 222 | |
| Fonds d'investissement | 8 700 | 0 | 0 | 8 700 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 3 700 | 0 | 3 700 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (769) | 1 671 | 0 | 902 |
| Totaux | € 7 931 | € 162 593 | € 0 | € 170 524 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Tableau des investissements Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (suite)

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 4,500 % | 22/11/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (598) | € (601) | (0,17) |
| MYI | 0,750 | 02/08/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (632) | (638) | (0,17) |
| | 3,000 | 02/08/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (614) | (619) | (0,17) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | € (1 858) | (0,51) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | € (2) | € 0 | € (2) | € (11) | € 0 | € (11) |
| BPS | (12) | 20 | 8 | (22) | 0 | (22) |
| BRC | S/O | S/O | S/O | 80 | 0 | 80 |
| CBK | S/O | S/O | S/O | 19 | 0 | 19 |
| GLM | (54) | 0 | (54) | (198) | 0 | (198) |
| GST | 58 | 0 | 58 | S/O | S/O | S/O |
| MBC | 131 | (260) | (129) | 230 | 0 | 230 |
| MYI | S/O | S/O | S/O | (8) | 0 | (8) |
| SCX | (62) | 0 | (62) | 207 | 0 | 207 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 75,86 | 80,86 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 7,39 | 8,16 |
| Autres valeurs mobilières | 0,02 | 1,26 |
| Fonds d'investissement | 4,97 | 5,00 |
| Contrats de mise en pension | 8,24 | 2,12 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,12 | (0,40) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,87 | 0,74 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,02 | 0,17 |
| Contrats de prise en pension | (0,51) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Autriche | 0,61 | S/O |
| Belgique | 0,81 | S/O |
| Îles Caïmans | S/O | 0,02 |
| Chine | 0,00 | 0,01 |
| République tchèque | 0,91 | 1,23 |
| Danemark | S/O | 1,34 |
| France | 11,44 | 12,16 |
| Allemagne | 8,27 | 6,94 |
| Irlande | 0,86 | 1,03 |
| Île de Man | S/O | 1,03 |
| Israël | 0,47 | S/O |
| Italie | 8,75 | 8,16 |
| Japon | 0,90 | 0,97 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 1,13 | 1,28 |
| Luxembourg | 5,84 | 8,62 |
| Multinationales | 0,92 | 0,53 |
| Pays-Bas | 9,48 | 6,59 |
| Norvège | 0,49 | S/O |
| Panama | 0,03 | 0,74 |
| Espagne | 2,99 | 2,40 |
| Suède | 3,39 | 4,04 |
| Suisse | 0,65 | 0,90 |
| Royaume-Uni | 11,13 | 12,74 |
| États-Unis | 9,09 | 8,45 |
| Instruments à court terme | 5,11 | 11,10 |
| Fonds d'investissement | 4,97 | 5,00 |
| Contrats de mise en pension | 8,24 | 2,12 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,12 | (0,40) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,13 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,44 | 0,17 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,30 | 0,57 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,00 | (0,12) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | (0,02) |
| Contrats de change à terme | 0,01 | 0,31 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 2,51 | 2,09 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|--|----------------------------------|------------------------------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | BANQUE ET FINANCE | | | | BANQUE ET FINANCE | | | | |
| ABN AMRO Bank NV | | | | 1,000 % éch. 01/10/2053 | DKK 2 | € 0 | 0,00 | Glenbeigh Issuer DAC | € 256 | € 256 | 0,20 | |
| 4,375 % éch. 22/09/2025 (d)(f) | € 800 | € 767 | 0,59 | 1,500 % éch. 01/10/2053 | | 273 | 0,02 | 4,666 % éch. 24/06/2050 | | | | |
| Banco Santander S.A. | | | | 2,000 % éch. 01/10/2053 | | 37 231 | 3 804 | 2,91 | Harbour Energy PLC | £ 489 | 565 | 0,43 |
| 3,625 % éch. 21/03/2029 (d)(f) | 600 | 450 | 0,35 | 3,000 % éch. 01/10/2053 | | 29 | 4 | 0,00 | 6,020 % éch. 28/01/2054 | | | |
| Bank of Ireland Group PLC | | | | 5,000 % éch. 01/10/2053 | | 20 800 | 2 807 | 2,15 | Harmony French Home Loans | € 299 | 300 | 0,23 |
| 7,500 % éch. 19/05/2025 (d)(f) | 300 | 305 | 0,23 | Santander UK Group Holdings PLC | | | | | 4,606 % éch. 27/05/2062 | | | |
| Barclays PLC | | | | 6,534 % éch. 10/01/2029 | \$ 800 | 750 | 0,57 | Hops Hill PLC | £ 281 | 326 | 0,25 | |
| 2,885 % éch. 31/01/2027 | 900 | 886 | 0,68 | Sirius Real Estate Ltd. | | | | | 6,498 % éch. 27/11/2054 | | | |
| Cooperatieve Rabobank UA | | | | 1,125 % éch. 22/06/2026 | € 400 | 362 | 0,28 | Jubilee Place BV | € 165 | 166 | 0,13 | |
| 4,875 % éch. 29/06/2029 (d)(f) | 200 | 181 | 0,14 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | | | Landmark Mortgage Securities PLC | £ 523 | 587 | 0,45 |
| Credit Suisse AG | | | | 3,629 % éch. 06/04/2026 | | 400 | 404 | 0,31 | 5,620 % éch. 17/04/2044 | | | |
| 5,185 % éch. 31/05/2024 | 900 | 903 | 0,69 | Virgin Money UK PLC | | | | | Lanebrook Mortgage Transaction PLC | € 450 | 516 | 0,40 |
| Credit Suisse AG AT1 Claim | | | | 4,625 % éch. 29/10/2028 | | 500 | 500 | 0,38 | 5,871 % éch. 20/07/2058 | | | |
| Credit Suisse Schweiz AG | | | | Volkswagen Bank GmbH | | | | | 6,320 % éch. 12/06/2057 | | | |
| 3,390 % éch. 05/12/2025 | € 900 | 902 | 0,69 | 1,875 % éch. 31/01/2024 | 2 700 | 2 695 | 2,06 | Miravet SARL | € 452 | 448 | 0,34 | |
| CTP NV | | | | Volkswagen Leasing GmbH | | | | | 5,985 % éch. 23/12/2058 | £ 607 | 699 | 0,54 |
| 0,500 % éch. 21/06/2025 | 800 | 754 | 0,58 | 4,500 % éch. 25/03/2026 | 400 | 409 | 0,31 | 5,995 % éch. 23/10/2059 | 364 | 418 | 0,32 | |
| 0,625 % éch. 27/09/2026 | 500 | 450 | 0,34 | Westpac Banking Corp. | | | | | Precise Mortgage Funding PLC | € 194 | 224 | 0,17 |
| Deutsche Bank AG | | | | 3,457 % éch. 04/04/2025 | 700 | 701 | 0,54 | 6,420 % éch. 12/12/2055 | | | | |
| 3,875 % éch. 12/02/2024 | £ 500 | 576 | 0,44 | | | 33 568 | 25,70 | Primrose Residential DAC | € 2 337 | 2 330 | 1,78 | |
| DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH | | | | INDUSTRIE | | | | 4,876 % éch. 24/10/2061 | 714 | 710 | 0,54 | |
| 2,500 % éch. 25/01/2027 | € 1 400 | 1 206 | 0,92 | GN Store Nord A/S | | | | Residential Mortgage Securities PLC | £ 375 | 433 | 0,33 | |
| Ford Motor Credit Co. LLC | | | | 0,875 % éch. 25/11/2024 | 1 300 | 1 246 | 0,95 | 6,470 % éch. 20/06/2070 | | | | |
| 1,744 % éch. 19/07/2024 | 400 | 394 | 0,30 | Prosus NV | | | | Resloc UK PLC | £ 247 | 276 | 0,21 | |
| 2,748 % éch. 14/06/2024 | £ 900 | 1 025 | 0,79 | 3,257 % éch. 19/01/2027 | \$ 1 100 | 920 | 0,71 | 5,499 % éch. 15/12/2043 | | | | |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | | Silfin NV | | | | Stanlington PLC | 429 | 495 | 0,38 | |
| 4,956 % éch. 07/02/2025 | € 1 100 | 1 101 | 0,84 | 2,875 % éch. 11/04/2027 | € 700 | 657 | 0,50 | 6,170 % éch. 12/06/2045 | | | | |
| ING Groep NV | | | | | | 2 823 | 2,16 | Stratton Mortgage Funding PLC | 424 | 486 | 0,37 | |
| 4,875 % éch. 16/05/2029 (d)(f) | \$ 200 | 150 | 0,12 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | 5,920 % éch. 12/12/2043 | 798 | 920 | 0,70 | |
| Jyske Realkredit A/S | | | | Électricité de France S.A. | | | | 6,069 % éch. 25/09/2051 | 458 | 529 | 0,41 | |
| 0,500 % éch. 01/10/2040 | DKK 0 | 0 | 0,00 | 2,625 % éch. 01/12/2027 (d) | 800 | 713 | 0,55 | 6,120 % éch. 12/03/2052 | 458 | 529 | 0,41 | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 1 | 0 | 0,00 | 2,875 % éch. 15/12/2026 (d) | 1 000 | 930 | 0,71 | 6,121 % éch. 20/07/2060 | 1 453 | 1 677 | 1,28 | |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 | | | 1 643 | 1,26 | Towd Point Mortgage Funding PLC | 500 | 575 | 0,44 | |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | Total Obligations et billets privés | | 38 034 | 29,12 | 5,891 % éch. 20/10/2051 | 584 | 675 | 0,52 | |
| LeasePlan Corp. NV | | | | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | 6,571 % éch. 20/07/2045 | 260 | 301 | 0,23 | |
| 3,500 % éch. 09/04/2025 | € 1 200 | 1 200 | 0,92 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | Tower Bridge Funding PLC | 500 | 576 | 0,44 | |
| Liberty Living Finance PLC | | | | 4,000 % éch. 01/02/2054 | \$ 3 050 | 2 614 | 2,00 | 6,000 % éch. 20/11/2063 | | | | |
| 2,625 % éch. 28/11/2024 | £ 1 200 | 1 347 | 1,03 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 10 100 | 8 869 | 6,79 | Trinity Square PLC | 679 | 783 | 0,60 | |
| Lloyds Banking Group PLC | | | | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 2 900 | 2 666 | 2,04 | 6,070 % éch. 15/07/2059 | | | | |
| 6,942 % éch. 07/08/2027 | \$ 600 | 544 | 0,42 | | | 14 149 | 10,83 | Tudor Rose Mortgages | 206 | 236 | 0,18 | |
| Logicor Financing SARL | | | | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | 5,820 % éch. 20/06/2048 | | | | |
| 0,750 % éch. 15/07/2024 | € 700 | 684 | 0,52 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c) | | | | Twin Bridges PLC | 450 | 520 | 0,40 | |
| NatWest Group PLC | | | | 0,125 % éch. 15/07/2031 | 1 492 | 1 202 | 0,92 | 6,470 % éch. 12/12/2054 | | | | |
| 3,073 % éch. 22/05/2028 | \$ 200 | 168 | 0,13 | 0,375 % éch. 15/07/2025 | 7 266 | 6 373 | 4,88 | | | | | |
| 4,269 % éch. 22/03/2025 | 300 | 271 | 0,21 | 0,500 % éch. 15/01/2028 | 873 | 748 | 0,57 | | | | | |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab | | | | 1,625 % éch. 15/10/2027 | 2 493 | 2 240 | 1,72 | | | | | |
| 0,500 % éch. 01/10/2040 | DKK 0 | 0 | 0,00 | 2,375 % éch. 15/01/2025 | 490 | 440 | 0,34 | | | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | | | 11 003 | 8,43 | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | Adagio CLO DAC | € 300 | 296 | 0,23 | |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 21 | 2 | 0,00 | Alba PLC | | | | 4,685 % éch. 15/10/2031 | | | | |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 599 | 62 | 0,05 | 5,509 % éch. 15/12/2038 | £ 563 | 633 | 0,48 | Ares European CLO DAC | 494 | 489 | 0,37 | |
| Nova Kreditna Banka Maribor d.d. | | | | Atlas Funding PLC | | | | 4,685 % éch. 15/07/2031 | 696 | 689 | 0,53 | |
| 1,875 % éch. 27/01/2025 | € 800 | 796 | 0,61 | 6,348 % éch. 20/01/2061 | 97 | 112 | 0,09 | Armada Euro CLO DAC | | | | |
| Nova Ljubljanska Banka d.d. | | | | Barley Hill PLC | | | | 4,635 % éch. 16/04/2030 | 198 | 196 | 0,15 | |
| 3,650 % éch. 19/11/2029 | 400 | 352 | 0,27 | 6,118 % éch. 27/08/2058 | 191 | 219 | 0,17 | 4,695 % éch. 16/01/2031 | 998 | 987 | 0,76 | |
| 10,750 % éch. 28/11/2032 | 900 | 983 | 0,75 | Canterbury Finance PLC | | | | 4,966 % éch. 23/03/2032 | 754 | 748 | 0,57 | |
| Nykredit Realkredit A/S | | | | 6,046 % éch. 16/05/2058 | 421 | 485 | 0,37 | Bain Capital Euro CLO DAC | 590 | 583 | 0,45 | |
| 0,500 % éch. 01/10/2040 | DKK 0 | 0 | 0,00 | Charter Mortgage Funding PLC | | | | BBVA Consumer Auto | 66 | 65 | 0,05 | |
| 1,000 % éch. 01/01/2024 | 1 700 | 228 | 0,18 | 5,796 % éch. 16/01/2057 | 135 | 156 | 0,12 | 0,270 % éch. 20/07/2031 | | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 2 | 0 | 0,00 | Cheshire PLC | | | | Black Diamond CLO DAC | 363 | 361 | 0,28 | |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 2 | 0 | 0,00 | 6,120 % éch. 20/08/2045 | 212 | 245 | 0,19 | 4,982 % éch. 15/05/2032 | 489 | 482 | 0,37 | |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | Dilock RMBS DAC | | | | BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | 99 | 94 | 0,07 | |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 1 287 | 119 | 0,09 | 4,638 % éch. 20/12/2060 | € 731 | 732 | 0,56 | 4,615 % éch. 15/07/2030 | 395 | 393 | 0,30 | |
| 2,000 % éch. 01/10/2053 | 42 | 5 | 0,00 | 4,752 % éch. 20/02/2060 | 331 | 332 | 0,25 | 4,685 % éch. 15/01/2031 | 596 | 589 | 0,45 | |
| 3,000 % éch. 01/10/2053 | 2 130 | 268 | 0,21 | Domi BV | | | | 4,875 % éch. 15/01/2033 | 800 | 788 | 0,60 | |
| 3,500 % éch. 01/10/2053 | 12 494 | 1 624 | 1,24 | 4,775 % éch. 15/06/2051 | 126 | 127 | 0,10 | BNPP AM Euro CLO DAC | 295 | 292 | 0,22 | |
| 5,000 % éch. 01/10/2053 | 8 727 | 1 175 | 0,90 | Dutch Property Finance BV | | | | 4,822 % éch. 22/07/2032 | 800 | 790 | 0,60 | |
| Permanent TSB Group Holdings PLC | | | | 4,602 % éch. 28/07/2058 | 621 | 620 | 0,47 | | | | | |
| 5,250 % éch. 30/06/2025 | € 600 | 600 | 0,46 | 4,652 % éch. 28/04/2059 | 648 | 646 | 0,49 | | | | | |
| Realkredit Danmark A/S | | | | 4,702 % éch. 28/10/2059 | 693 | 693 | 0,53 | | | | | |
| 1,000 % éch. 01/01/2024 | DKK 4 100 | 550 | 0,42 | 5,202 % éch. 28/04/2050 | 235 | 234 | 0,18 | | | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Bridgepoint CLO DAC | € 300 | € 298 | 0,23 | 4,955 % éch. 28/02/2048 | € 466 | € 468 | 0,36 | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | 500 | 473 | 0,36 |
| 5,175 % éch. 15/01/2034 | | | | Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | 0,000 % éch. 16/09/2025 (a) | | | |
| Bumper UK Finance PLC | £ 55 | 63 | 0,05 | 4,685 % éch. 15/10/2031 | 956 | 941 | 0,72 | | | | |
| 5,698 % éch. 20/12/2030 | | | | 4,695 % éch. 15/07/2031 | 789 | 780 | 0,60 | | | | |
| Carlyle Euro CLO DAC | € 401 | 397 | 0,30 | 5,015 % éch. 15/10/2031 | 1 170 | 1 157 | 0,89 | | | | |
| 4,632 % éch. 15/08/2030 | | | | Red & Black Auto Italy SRL | 471 | 473 | 0,36 | | | | |
| 4,665 % éch. 15/01/2031 | | | | Red & Black Auto Lease France | 400 | 401 | 0,31 | | | | |
| 4,892 % éch. 15/08/2032 | | | | 4,556 % éch. 27/06/2035 | | | | | | | |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC | 783 | 773 | 0,59 | Sculptor European CLO DAC | 700 | 690 | 0,53 | | | | |
| 4,686 % éch. 25/01/2032 | | | | 4,755 % éch. 14/01/2032 | | | | | | | |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | 1 098 | 1 083 | 0,83 | Segovia European CLO DAC | 158 | 157 | 0,12 | | | | |
| 4,752 % éch. 15/11/2031 | | | | 4,745 % éch. 18/01/2031 | 800 | 790 | 0,60 | | | | |
| Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC | 99 | 99 | 0,08 | 4,873 % éch. 20/07/2032 | | | | | | | |
| 4,653 % éch. 15/12/2029 | | | | Silver Arrow Merfina SRL | 234 | 234 | 0,18 | | | | |
| Contego CLO DAC | 498 | 491 | 0,38 | 4,559 % éch. 20/07/2033 | | | | | | | |
| 4,642 % éch. 25/01/2030 | | | | Tikehau CLO DAC | 600 | 593 | 0,45 | | | | |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC | 299 | 294 | 0,23 | 4,844 % éch. 04/08/2034 | | | | | | | |
| 4,555 % éch. 15/09/2031 | | | | Toro European CLO DAC | 1 000 | 986 | 0,75 | | | | |
| 4,615 % éch. 15/10/2031 | 1 796 | 1 772 | 1,36 | 4,812 % éch. 15/02/2034 | 1 200 | 1 191 | 0,91 | | | | |
| Dryden Euro CLO DAC | 398 | 392 | 0,30 | 4,908 % éch. 12/01/2032 | | | | | | | |
| 4,625 % éch. 15/04/2033 | | | | Voya Euro CLO DAC | 254 | 252 | 0,19 | | | | |
| Harvest CLO DAC | 400 | 379 | 0,29 | 4,715 % éch. 15/10/2030 | | | | | | | |
| 1,040 % éch. 15/07/2031 | | | | | | | | | | | |
| 4,566 % éch. 26/06/2030 | | | | | | | | | | | |
| 4,605 % éch. 15/10/2031 | | | | | | | | | | | |
| 4,673 % éch. 20/10/2031 | 1 771 | 1 745 | 1,34 | | | | | | | | |
| 4,725 % éch. 15/07/2031 | 700 | 690 | 0,53 | | | | | | | | |
| 4,815 % éch. 15/01/2032 | 1 200 | 1 185 | 0,91 | | | | | | | | |
| Man GLG Euro CLO DAC | 204 | 203 | 0,16 | | | | | | | | |
| 4,645 % éch. 15/10/2030 | | | | | | | | | | | |
| 4,775 % éch. 15/10/2032 | 573 | 566 | 0,43 | | | | | | | | |
| Marzio Finance SRL | | | | | | | | | | | |

ACTIONS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Nationwide Building Society | 3 504 | 527 | 0,40 |
| 10,250 % | | | |

TITRES PRIVILÉGIÉS

INSTRUMENTS À COURT TERME

BONS DU TRÉSOR HONGROIS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 10,900 % éch. | | | |
| 04/01/2024 (a)(b) | HUF 116 000 | 303 | 0,23 |
| Total des Instruments à court terme | | 303 | 0,23 |

ACTIONS

FONDS D'INVESTISSEMENT

FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| PIMCO ETFs plc - Fonds | | | |
| PIMCO Euro | | | |
| Short Maturity UCITS | | | |
| ETF (e) | 77 600 | 7 680 | 5,88 |
| Total des Fonds d'investissement | | € 7 680 | 5,88 |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|-----------------|----------------------|--------------------|-------------------------|---|---------------------|--|--|------------------------|
| BPS | 3,500 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | € 1 000 | Obligation internationale du gouvernement belge | € (987) | € 1 000 | € 1 000 | 0,77 |
| | | | | | 0,650 % éch. 22/06/2071 | | | | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | € (987) | € 1 000 | € 1 000 | 0,77 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|----------------------|---------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Court | 09/2025 | 54 | € (42) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Long | 09/2026 | 54 | 33 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Long | 03/2024 | 60 | 116 | 0,09 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Court | 03/2024 | 4 | (16) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 44 | (191) | (0,15) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 11 | (126) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Long | 03/2024 | 260 | 145 | 0,11 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 75 | (110) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 211 | (511) | (0,39) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 144 | 538 | 0,41 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 79 | (411) | (0,31) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 15 | (125) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 6 | 66 | 0,05 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 2 | (16) | (0,01) |
| | | | | € (650) | (0,49) |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|--------------------|----------------------|---------------------|-------|-----------------|------------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation EUREX Euro-Bund février 2024 | € 137,000 | 26/01/2024 | 6 | € (4) | € (8) | (0,01) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | | € (658) | (0,50) |

Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | (5,000) % | 20/12/2028 | € 3 000 | € (131) | (0,10) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2028 | \$ 1 700 | € 10 | 0,01 |
| Indice iTraxx Europe Main 40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | € 5 200 | 26 | 0,02 |
| | | | | € 36 | 0,03 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 200 | € (30) | (0,02) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,865 | 13/02/2054 | \$ 1 200 | 61 | 0,05 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,085 | 13/02/2034 | 5 000 | (96) | (0,07) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 3 000 | 87 | 0,07 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 6 900 | (76) | (0,06) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 1 400 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,827 | 15/12/2025 | 2 700 | (23) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | € 800 | (24) | (0,02) |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,819 | 19/12/2034 | 6 800 | (499) | (0,38) |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,854 | 19/12/2039 | 3 100 | (421) | (0,32) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,700 | 15/03/2073 | 300 | 21 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | 700 | 25 | 0,02 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 8 200 | (953) | (0,73) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,804 | 19/05/2033 | 2 700 | 189 | 0,14 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 14 650 | 941 | 0,72 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2044 | 200 | (25) | (0,02) |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 3 500 | 3 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 42 400 | (676) | (0,52) |
| | | | | | € (1 494) | (1,15) |
| | | | | | € (1 589) | (1,22) |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

⁽¹⁾ Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽³⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽⁴⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 % | 16/01/2024 | 2 700 | € (12) | € (34) | (0,03) |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,900 | 29/08/2025 | 7 400 | (88) | (147) | (0,11) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,900 | 29/08/2025 | 7 400 | (88) | (34) | (0,02) |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 0,008 | 17/12/2029 | 10 900 | (352) | (142) | (0,11) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 0,008 | 17/12/2029 | 5 500 | (342) | (127) | (0,10) |
| | | | | | | | € (882) | € (484) | (0,37) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| BOA | 03/2024 | CNH | 8 360 | \$ 1 163 | € 0 | € (16) | (0,01) | |
| | 06/2024 | KRW | 777 610 | 598 | 0 | (7) | (0,01) | |
| BPS | 01/2024 | € | 139 | DKK 1 035 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 745 | \$ 815 | 0 | (8) | (0,01) | |
| | 01/2024 | £ | 88 | € 102 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 32 217 | \$ 92 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 365 | € 334 | 4 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 557 | ZAR 10 326 | 6 | 0 | 0,01 | |
| BRC | 01/2024 | DKK | 1 200 | € 161 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 893 | 1 728 | 15 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | | 300 | IDR 4 661 496 | 2 | 0 | 0,00 | |
| CBK | 01/2024 | DKK | 42 500 | € 5 702 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 2 276 | \$ 7 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | MXN | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | DKK | 29 080 | € 3 902 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 323 | ¥ 52 188 | 12 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 330 | \$ 356 | 0 | (7) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 75 | MXN 1 314 | 2 | 0 | 0,00 | |
| JPM | 01/2024 | HUF | 77 433 | \$ 220 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 506 | MXN 8 703 | 5 | 0 | 0,01 | |
| | 02/2024 | | 450 | BRL 2 207 | 3 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | DKK | 1 300 | € 174 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 14 531 | 13 216 | 66 | 0 | 0,05 | |
| MYI | 01/2024 | € | 779 | £ 670 | 0 | (6) | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 953 | \$ 1 045 | 0 | (7) | (0,01) | |
| | 01/2024 | HUF | 3 976 | 11 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 210 | € 195 | 5 | 0 | 0,00 | |
| RBC | 04/2024 | | 0 | MXN 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| RYL | 01/2024 | € | 140 | £ 122 | 0 | 0 | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | CAD | 1 932 | € 1 295 | 0 | (32) | (0,02) | |
| | 01/2024 | £ | 16 290 | 18 763 | 0 | (34) | (0,02) | |
| | 03/2024 | TWD | 26 892 | \$ 865 | 0 | (24) | (0,02) | |
| | 03/2024 | \$ | 281 | INR 23 477 | 0 | 0 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | DKK | 5 715 | € 768 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 200 | £ 172 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 267 | INR 22 331 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | | | | | € 124 | € (146) | € (22) | (0,02) |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | € (506) | (0,39) | |
| Total des Investissements | | | | | | € 137 963 | 105,63 | |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | € (7 353) | (5,63) | |
| Actifs nets | | | | | | € 130 610 | 100,00 | |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- Titre à coupon zéro.
- Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- Affilié au Fonds.
- Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 1 867 € (31 décembre 2022 : 3 688 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 39 € (31 décembre 2022 : 1 165 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|--------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 132 036 | € 0 | € 132 036 |
| Fonds d'investissement | 7 680 | 0 | 0 | 7 680 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 000 | 0 | 1 000 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (105) | (2 648) | 0 | (2 753) |
| Totaux | € 7 575 | € 130 388 | € 0 | € 137 963 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | € 0 | € 193 346 | € 0 | € 193 346 |
| Fonds d'investissement | 18 800 | 0 | 0 | 18 800 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 4 400 | 0 | 4 400 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 731 | (1 267) | 0 | (536) |
| Totaux | € 19 531 | € 196 479 | € 0 | € 216 010 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | | | | |
|--------------|--|-------|-------------------------|--|---|-------------------------|-----------------------------------|-------|---|-------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | | Garantie (reçue)/nantie | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | | | |
| AZD | € | S/O | € | S/O | € | 3 | € | 0 | € | 3 |
| BOA | | (23) | | 0 | | (9) | | (440) | | (449) |
| BPS | | (32) | | 0 | | (397) | | 360 | | (37) |
| BRC | | 17 | | 0 | | 17 | | 0 | | (93) |
| CBK | | 1 | | 0 | | 1 | | 290 | | 225 |
| CLY | | S/O | | S/O | | S/O | | 0 | | 1 |
| GLM | | (174) | | 0 | | (174) | | (169) | | (249) |
| GST | | S/O | | S/O | | S/O | | 253 | | (59) |
| JPM | | 5 | | 0 | | 5 | | 262 | | (64) |
| MBC | | 66 | | 0 | | 66 | | 0 | | (27) |
| MYC | | (269) | | (244) | | (513) | | (253) | | (562) |
| MYI | | (8) | | 9 | | 1 | | 0 | | (18) |
| RYL | | S/O | | S/O | | S/O | | 0 | | 6 |
| SCX | | (90) | | 30 | | (60) | | 0 | | 6 |
| SSB | | S/O | | S/O | | S/O | | (328) | | 63 |
| UAG | | 1 | | 0 | | 1 | | S/O | | S/O |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû/de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 89,78 | 78,37 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 10,88 | 13,20 |
| Autres valeurs mobilières | 0,43 | S/O |
| Fonds d'investissement | 5,88 | 8,90 |
| Contrats de mise en pension | 0,77 | 2,08 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,50) | 0,34 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (1,22) | (0,02) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,39) | (0,58) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 29,12 | 39,32 |
| Agences du gouvernement américain | 10,83 | 5,19 |
| Obligations du Trésor américain | 8,43 | 2,49 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 16,56 | 14,49 |
| Titres adossés à des actifs | 22,67 | 15,94 |
| Émissions souveraines | 12,85 | 7,09 |
| Titres privilégiés | 0,40 | 0,30 |
| Instruments à court terme | 0,23 | 6,75 |
| Fonds d'investissement | 5,88 | 8,90 |
| Contrats de mise en pension | 0,77 | 2,08 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,49) | 0,34 |
| Options vendues | | |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | (0,01) | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,10) | (0,21) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,03 | 0,01 |
| Swaps de taux d'intérêt | (1,15) | 0,18 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,48 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,37) | (1,25) |
| Contrats de change à terme | (0,02) | 0,19 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (5,63) | (2,29) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | |
| ARGENTINE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement argentin | | | |
| 0,750 % éch. 09/07/2030 | \$ 254 | \$ 100 | 0,02 |
| 1,000 % éch. 09/07/2029 | 3 | 1 | 0,00 |
| 3,625 % éch. 09/07/2035 | 91 | 30 | 0,01 |
| Total Argentine | | 131 | 0,03 |
| AUSTRALIE | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| RESIMAC Bastille Trust | | | |
| 6,390 % éch. 05/09/2057 | 36 | 36 | 0,01 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement australien | | | |
| 0,500 % éch. 21/09/2026 | AUD 4 100 | 2 575 | 0,60 |
| 0,750 % éch. 21/11/2027 | 2 565 | 1 731 | 0,40 |
| 1,000 % éch. 21/12/2030 | 700 | 397 | 0,09 |
| 1,250 % éch. 21/05/2032 | 500 | 277 | 0,06 |
| 1,750 % éch. 21/06/2051 | 700 | 282 | 0,07 |
| 2,500 % éch. 21/05/2030 | 500 | 317 | 0,07 |
| 4,500 % éch. 21/04/2033 | 2 100 | 1 495 | 0,35 |
| | | 7 074 | 1,64 |
| Total Australie | | 7 110 | 1,65 |
| BRÉSIL | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. | | | |
| 0,000 % éch. 29/01/2024 (c)(f) | \$ 254 | 9 | 0,00 |
| BULGARIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare | | | |
| 4,375 % éch. 13/05/2031 | € 1 600 | 1 861 | 0,43 |
| CANADA | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Air Canada Pass-Through Trust | | | |
| 3,300 % éch. 15/07/2031 | \$ 372 | 335 | 0,08 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. | | | |
| 2,750 % éch. 29/03/2028 | € 400 | 422 | 0,10 |
| Royal Bank of Canada | | | |
| 4,851 % éch. 14/12/2026 | \$ 1 000 | 1 008 | 0,23 |
| | | 1 765 | 0,41 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement canadien | | | |
| 2,750 % éch. 01/12/2033 | CAD 4 000 | 3 073 | 0,71 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien | | | |
| 1,500 % éch. 01/12/2044 (e) | 2 607 | 1 957 | 0,45 |
| | | 5 030 | 1,16 |
| Total Canada | | 6 795 | 1,57 |
| ÎLES CAÏMANS | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | |
| 6,745 % éch. 15/01/2031 | \$ 801 | 802 | 0,19 |
| 6,805 % éch. 16/01/2030 | 608 | 607 | 0,14 |
| Bain Capital Credit CLO | | | |
| 6,634 % éch. 23/04/2031 | 1 140 | 1 141 | 0,26 |
| Barings CLO Ltd. | | | |
| 6,667 % éch. 20/01/2031 | 1 052 | 1 051 | 0,24 |
| CBAM Ltd. | | | |
| 6,684 % éch. 17/04/2031 | 1 238 | 1 236 | 0,29 |
| Dryden CLO Ltd. | | | |
| 6,675 % éch. 15/04/2031 | 1 353 | 1 353 | 0,31 |
| Dryden Senior Loan Fund | | | |
| 6,852 % éch. 15/08/2030 | 1 143 | 1 143 | 0,26 |
| OCP CLO Ltd. | | | |
| 6,797 % éch. 20/07/2029 | 755 | 755 | 0,18 |
| Octagon Loan Funding Ltd. | | | |
| 6,809 % éch. 18/11/2031 | 1 300 | 1 302 | 0,30 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Venture CLO Ltd. | | | |
| 6,535 % éch. 15/04/2027 | \$ 112 | \$ 112 | 0,03 |
| 6,727 % éch. 20/07/2030 | 1 170 | 1 169 | 0,27 |
| Wind River CLO Ltd. | | | |
| 6,707 % éch. 18/07/2031 | 1 177 | 1 176 | 0,27 |
| | | 11 847 | 2,74 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Gaci First Investment Co. | | | |
| 4,750 % éch. 14/02/2030 | 1 400 | 1 402 | 0,32 |
| 4,875 % éch. 14/02/2035 | 1 500 | 1 468 | 0,34 |
| 5,125 % éch. 14/02/2053 | 700 | 635 | 0,15 |
| KSA Sukuk Ltd. | | | |
| 5,268 % éch. 25/10/2028 | 400 | 416 | 0,10 |
| QNB Finance Ltd. | | | |
| 1,375 % éch. 26/01/2026 | 400 | 370 | 0,09 |
| Sands China Ltd. | | | |
| 4,300 % éch. 08/01/2026 | 200 | 192 | 0,04 |
| 5,375 % éch. 08/08/2025 | 400 | 395 | 0,09 |
| | | 4 878 | 1,13 |
| Total Îles Caïmans | | 16 725 | 3,87 |
| CHILI | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Bonos de la Tesorería de la República en Pesos | | | |
| 4,500 % éch. 01/03/2026 | 1 120 0 | | |
| | CLP 00 | 1 262 | 0,29 |
| CHINE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement chinois | | | |
| 3,190 % éch. 15/04/2053 | CNY 2 000 | 300 | 0,07 |
| COLOMBIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement colombien | | | |
| 7,500 % éch. 02/02/2034 | \$ 1 900 | 2 010 | 0,47 |
| TES colombien | | | |
| 5,750 % éch. 03/11/2027 | COP570 000 | 131 | 0,03 |
| Total Colombie | | 2 141 | 0,50 |
| RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque | | | |
| 0,950 % éch. 15/05/2030 | CZK 12 100 | 458 | 0,11 |
| DANEMARK | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Jyske Realkredit A/S | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 18 440 | 2 101 | 0,49 |
| 1,500 % éch. 01/10/2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/07/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 1 138 | 137 | 0,03 |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 42 893 | 4 751 | 1,10 |
| 1,500 % éch. 01/10/2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 379 | 46 | 0,01 |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| Nykredit Realkredit A/S | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 14 944 | 1 734 | 0,40 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 10 540 | 1 213 | 0,28 |
| 2,000 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % éch. 01/10/2036 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 |
| Realkredit Danmark A/S | | | |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 3 548 | 412 | 0,09 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 3 301 | 387 | 0,09 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 2,500 % éch. 01/04/2036 | | | |
| DKK 0 | \$ 0 | 0,00 | |
| 2,500 % éch. 01/04/2047 | | | |
| 0 | 0 | 0,00 | |
| Total Danemark | | 10 781 | 2,49 |
| RÉPUBLIQUE DOMINICAINE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine | | | |
| 4,875 % éch. 23/09/2032 | \$ 600 | 548 | 0,12 |
| 6,500 % éch. 15/02/2048 | 800 | 767 | 0,18 |
| Total République dominicaine | | 1 315 | 0,30 |
| FRANCE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| BNP Paribas S.A. | | | |
| 3,800 % éch. 10/01/2024 | 300 | 300 | 0,07 |
| Société Générale S.A. | | | |
| 1,488 % éch. 14/12/2026 | 2 800 | 2 579 | 0,60 |
| 6,446 % éch. 10/01/2029 | 900 | 932 | 0,22 |
| 6,691 % éch. 10/01/2034 | 1 000 | 1 057 | 0,24 |
| | | 4 868 | 1,13 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement français | | | |
| 0,100 % éch. 25/07/2031 (e) | € 1 774 | 1 933 | 0,45 |
| 0,250 % éch. 25/07/2024 (e) | 1 888 | 2 072 | 0,48 |
| 0,500 % éch. 25/05/2072 | 100 | 46 | 0,01 |
| 0,750 % éch. 25/05/2052 | 3 550 | 2 249 | 0,52 |
| 1,500 % éch. 25/05/2050 | 200 | 161 | 0,04 |
| 3,000 % éch. 25/05/2054 | 400 | 434 | 0,10 |
| 3,250 % éch. 25/05/2045 | 200 | 231 | 0,05 |
| | | 7 126 | 1,65 |
| Total France | | 11 994 | 2,78 |
| ALLEMAGNE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Deutsche Bank AG | | | |
| 0,050 % éch. 20/11/2024 | 3 800 | 4 069 | 0,94 |
| 1,375 % éch. 03/09/2026 | 400 | 423 | 0,10 |
| 1,375 % éch. 17/02/2032 | 400 | 364 | 0,09 |
| 1,625 % éch. 20/01/2027 | 2 500 | 2 597 | 0,60 |
| 1,750 % éch. 19/11/2030 | 400 | 384 | 0,09 |
| 3,035 % éch. 28/05/2032 (h) | \$ 1 050 | 878 | 0,20 |
| Total Allemagne | | 8 715 | 2,02 |
| GUATEMALA | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement du Guatemala | | | |
| 5,375 % éch. 24/04/2032 | 400 | 388 | 0,09 |
| HONGRIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois | | | |
| 5,000 % éch. 22/02/2027 | € 100 | 116 | 0,03 |
| 5,375 % éch. 12/09/2033 | 1 300 | 1 538 | 0,36 |
| 6,250 % éch. 22/09/2032 | \$ 1 500 | 1 604 | 0,37 |
| 6,750 % éch. 25/09/2052 | 500 | 561 | 0,13 |
| Magyar Export-Import Bank | | | |
| 6,125 % éch. 04/12/2027 | 2 100 | 2 140 | 0,49 |
| Total Hongrie | | 5 959 | 1,38 |
| INDONÉSIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara | | | |
| 3,000 % éch. 30/06/2030 | 3 500 | 3 124 | 0,72 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien | | | |
| 8,375 % éch. 15/03/2034 | IDR 22 982 000 | 1 688 | 0,39 |
| Total Indonésie | | 4 812 | 1,11 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | | | | | | |
|--|-------------------------------------|---|------------------------------|--|--|---|------------------------------|---|--|---|---|--|--------|-------|-------|------------------------------|--------|-------|------|
| IRLANDE | | | | ITALIE | | | | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | |
| Accunia European CLO DAC 4,915 % éch. 15/07/2030 | € | 365 | \$ 403 | 0,09 | Obligation internationale du gouvernement italien 6,000 % éch. 04/08/2028 | £ | 1 000 | \$ 1 340 | 0,31 | Miravet SARL 4,806 % éch. 26/05/2065 | € | 452 | \$ 495 | 0,11 | | | | | |
| Ares European CLO DAC 4,745 % éch. 15/10/2031 | 1 086 | 1 188 | 0,27 | Total Italie | | | 31 473 | 7,28 | Total Luxembourg | | | 5 375 | 1,24 | | | | | | |
| Armada Euro CLO DAC 4,685 % éch. 15/07/2031 | 398 | 435 | 0,10 | CÔTE D'IVOIRE | | | | MALAISIE | | | | | | | | | | | |
| Aurium CLO DAC 4,695 % éch. 16/01/2031 | 1 097 | 1 199 | 0,28 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | |
| BNPP AM Euro CLO DAC 4,822 % éch. 22/07/2032 | 1 000 | 1 090 | 0,25 | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire | | | | Petronas Capital Ltd. 2,480 % éch. 28/01/2032 | | | | \$ | 500 | 427 | 0,10 | | | | |
| Cairn CLO DAC 4,552 % éch. 30/04/2031 | 379 | 413 | 0,10 | 5,250 % éch. 22/03/2030 | | | | € | 1 600 | 1 593 | 0,37 | 3,500 % éch. 21/04/2030 | 200 | 188 | 0,04 | | | | |
| Carlyle Euro CLO DAC 4,665 % éch. 15/01/2031 | 992 | 1 085 | 0,25 | 5,875 % éch. 17/10/2031 | | | | 700 | 695 | 0,16 | 4,550 % éch. 21/04/2050 | 200 | 184 | 0,04 | | | | | |
| Dryden Euro CLO DAC 4,625 % éch. 15/04/2033 | 696 | 758 | 0,18 | Total Côte d'Ivoire | | | | | 2 288 | 0,53 | 4,800 % éch. 21/04/2060 | 200 | 190 | 0,05 | | | | | |
| 4,862 % éch. 15/05/2034 | 998 | 1 086 | 0,25 | JAPON | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | |
| GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,893 % éch. 20/01/2032 | 1 000 | 1 093 | 0,25 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Obligation internationale du gouvernement japonais | | | | | | | | | | | |
| Harvest CLO DAC 4,566 % éch. 26/06/2030 | 728 | 795 | 0,18 | Nomura Holdings, Inc. 2,329 % éch. 22/01/2027 | | | | \$ | 400 | 367 | 0,09 | 3,519 % éch. 20/04/2028 | MYR | 4 621 | 1 004 | 0,23 | | | |
| 4,673 % éch. 20/10/2031 | 787 | 857 | 0,20 | Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % éch. 07/11/2029 | | | | € | 1 300 | 1 227 | 0,28 | Total Malaisie | | | 1 993 | 0,46 | | | |
| 4,725 % éch. 15/07/2031 | 1 100 | 1 198 | 0,28 | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % éch. 13/01/2028 | | | | \$ | 1 200 | 1 229 | 0,28 | MULTINATIONALES | | | | | | | |
| 4,815 % éch. 15/01/2032 | 1 100 | 1 200 | 0,28 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % éch. 15/10/2027 | | | | € | 1 000 | 984 | 0,23 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | |
| Jubilee CLO DAC 4,565 % éch. 15/04/2030 | 550 | 602 | 0,14 | Total Japon | | | | | 3 807 | 0,88 | Preferred Term Securities Ltd. 6,039 % éch. 23/06/2035 | | | | \$ | 949 | 912 | 0,21 | |
| 4,615 % éch. 15/04/2031 | 400 | 435 | 0,10 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | PAYS-BAS | | | | | | | | | | | |
| Madison Park Euro Funding DAC 4,765 % éch. 15/07/2032 | 1 100 | 1 199 | 0,28 | Obligation internationale du gouvernement japonais | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | |
| Man GLG Euro CLO DAC 4,615 % éch. 15/12/2031 | 554 | 605 | 0,14 | 0,005 % éch. 01/10/2024 | | | | ¥ | 1 050 000 | 7 452 | 1,72 | Cooperatieve Rabobank UA 3,758 % éch. 06/04/2033 | | | | 400 | 359 | 0,08 | |
| Oak Hill European Credit Partners DAC 4,733 % éch. 20/10/2031 | 1 097 | 1 199 | 0,28 | 0,100 % éch. 10/03/2028 (e) | | | | 907 398 | 6 764 | 1,57 | CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025 | | | | € | 1 100 | 1 146 | 0,27 | |
| OCP Euro CLO DAC 4,882 % éch. 22/09/2034 | 800 | 871 | 0,20 | 0,100 % éch. 10/03/2029 (e) | | | | 535 115 | 3 999 | 0,93 | ING Groep NV 2,125 % éch. 23/05/2026 | | | | 500 | 541 | 0,13 | | |
| Palmer Square European Loan Funding DAC 4,500 % éch. 15/07/2031 | 868 | 948 | 0,22 | 0,500 % éch. 20/03/2049 | | | | 238 000 | 1 310 | 0,30 | Prosus NV 1,207 % éch. 19/01/2026 | | | | 1 500 | 1 563 | 0,36 | | |
| Sculptor European CLO DAC 4,755 % éch. 14/01/2032 | 1 100 | 1 198 | 0,28 | 0,700 % éch. 20/06/2051 | | | | 254 000 | 1 432 | 0,33 | 3,257 % éch. 19/01/2027 | | | | \$ | 1 600 | 1 479 | 0,34 | |
| | | 19 857 | 4,60 | 1,500 % éch. 20/09/2043 | | | | 360 000 | 2 601 | 0,60 | Total Pays-Bas | | | | | | 5 545 | 1,28 | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | KAZAKHSTAN | | | | NOUVELLE-ZÉLANDE | | | | | | | | | | | |
| AerCap Ireland Capital DAC 2,450 % éch. 29/10/2026 | \$ | 400 | 370 | 0,08 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | |
| 3,000 % éch. 29/10/2028 | 500 | 457 | 0,11 | KazMunayGas National Co. JSC 3,500 % éch. 14/04/2033 | | | | \$ | 1 550 | 1 292 | 0,30 | Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais 1,500 % éch. 15/05/2031 | | | | NZD | 600 | 314 | 0,07 |
| | | 827 | 0,19 | 5,750 % éch. 19/04/2047 | | | | 200 | 176 | 0,04 | NORVÈGE | | | | | | | | |
| Total Irlande | | 20 684 | 4,79 | 6,375 % éch. 24/10/2048 | | | | 400 | 377 | 0,09 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | |
| ISRAËL | | | | LUXEMBOURG | | | | ACTIONS | | | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ACTIONS ORDINAIRES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement israélien | | | | DrillCo Holding Lux S.A. (b) | | | | Kommunalbanken A/S 1,900 % éch. 19/01/2027 | | | | AUD | 400 | 255 | 0,06 | | | | |
| 1,750 % éch. 31/08/2025 | ILS | 2 100 | 564 | 0,13 | DrillCo Holding Lux S.A. (b)(h) | | | | Obligation internationale du gouvernement norvégien 1,750 % éch. 13/03/2025 | | | | NOK | 6 000 | 576 | 0,13 | | | |
| 2,000 % éch. 31/03/2027 | 2 700 | 713 | 0,17 | Total des Actions ordinaires | | | | | 565 | 0,13 | Total Norvège | | | | | | 831 | 0,19 | |
| 4,500 % éch. 17/01/2033 | \$ | 2 200 | 2 095 | 0,48 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | PÉROU | | | | | | | | | | |
| 5,000 % éch. 30/10/2026 | € | 4 200 | 4 748 | 1,10 | Arroundtown S.A. 0,375 % éch. 15/04/2027 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | |
| Total Israël | | 8 120 | 1,88 | CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,900 % éch. 12/10/2029 | | | | 300 | 276 | 0,06 | Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % éch. 17/09/2024 | | | | PEN | 1 700 | 446 | 0,11 | |
| ITALIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | PHILIPPINES | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | |
| AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % éch. 06/02/2027 | 600 | 682 | 0,16 | Chile Electricity Lux MPC SARL 6,010 % éch. 20/01/2033 | | | | \$ | 1 000 | 1 026 | 0,24 | Obligation internationale du gouvernement philippin 6,250 % éch. 14/01/2036 | | | | PHP | 21 000 | 362 | 0,08 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % éch. 08/10/2027 | 1 300 | 1 340 | 0,31 | CPI Property Group S.A. 1,625 % éch. 23/04/2027 | | | | € | 700 | 624 | 0,15 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | |
| 6,750 % éch. 05/09/2027 | 400 | 463 | 0,11 | 1,750 % éch. 14/01/2030 | | | | 300 | 189 | 0,04 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | |
| Intesa Sanpaolo SpA 5,125 % éch. 29/08/2031 | 600 | 708 | 0,16 | FORESEA Holding S.A. 7,500 % éch. 15/06/2030 | | | | \$ | 284 | 263 | 0,06 | Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,200 % éch. 12/08/2026 | | | | 2 100 | 603 | 0,14 | |
| | | 3 193 | 0,74 | Logicor Financing SARL 0,625 % éch. 17/11/2025 | | | | € | 200 | 206 | 0,05 | Total Pérou | | | | | | 2 139 | 0,50 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % éch. 05/05/2026 | | | | \$ | 600 | 600 | 0,14 | TMS Issuer SARL 5,780 % éch. 23/08/2032 | | | | \$ | 800 | 837 | 0,19 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % éch. 15/09/2024 (e) | € | 23 788 | 26 340 | 6,09 | Total | | | | | 4 315 | 1,00 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | VALEUR JUSTE L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|---|------------------------------|--|-------------------------------------|---|------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|---|------------------------------|
| Pologne | | | | Slovenie | | | | MDGH GMTN RSC Ltd. | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,500 % éch. 28/04/2033 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement polonais | | | | Nova Kreditna Banka Maribor d.d. | | | | \$ | 200 | \$ 212 | 0,05 |
| 3,875 % éch. 14/02/2033 | € 1 300 | \$ 1 497 | 0,35 | 1,875 % éch. 27/01/2025 | € 400 | \$ 440 | 0,10 | Total Émirats arabes unis | | | |
| 4,250 % éch. 14/02/2043 | 900 | 1 049 | 0,24 | Nova Ljubljanska Banka d.d. | | | | | | 1 999 | 0,46 |
| 4,875 % éch. 04/10/2033 | \$ 400 | 406 | 0,09 | 3,400 % éch. 05/02/2030 | 400 | 383 | 0,09 | ROYAUME-UNI | | | |
| 5,500 % éch. 16/11/2027 | 100 | 104 | 0,03 | Total Slovenie | | 823 | 0,19 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 5,500 % éch. 04/04/2053 | 300 | 314 | 0,07 | AFRIQUE DU SUD | | | | Antofagasta PLC | | | |
| Total Pologne | | 3 370 | 0,78 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,375 % éch. 14/10/2030 | | | |
| PORTUGAL | | | | OBLIGATIONS INTERNATIONALE DU GOUVERNEMENT SUD-AFRICAIN | | | | Barclays PLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,375 % éch. 24/07/2044 | | | | 6,224 % éch. 09/05/2034 | | | |
| Banco Espírito Santo S.A. | | | | 5,750 % éch. 30/09/2049 | 200 | 160 | 0,04 | 7,437 % éch. 02/11/2033 | | | |
| 4,000 % éch. 21/01/2019 ^ | € 1 900 | 577 | 0,14 | Total Afrique du Sud | | 400 | 0,09 | Haleon UK Capital PLC | | | |
| 4,750 % éch. 15/01/2018 ^ | 600 | 182 | 0,04 | CORÉE DU SUD | | | | 3,125 % éch. 24/03/2025 | | | |
| Total Portugal | | 759 | 0,18 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 700 | | | |
| QATAR | | | | OBLIGATIONS INTERNATIONALE DU GOUVERNEMENT SUD-CORÉEN | | | | 700 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,000 % éch. 10/06/2031 | | | | 730 | | | |
| QatarEnergy | | | | 2,125 % éch. 10/06/2027 | 680 000 | 510 | 0,12 | 2,251 % éch. 22/11/2027 | | | |
| 2,250 % éch. 12/07/2031 | \$ 200 | 170 | 0,04 | 2,375 % éch. 10/12/2028 | 3 873 730 | 2 902 | 0,67 | 4,041 % éch. 13/03/2028 | | | |
| 3,300 % éch. 12/07/2051 | 200 | 147 | 0,03 | 2,625 % éch. 10/06/2028 | 981 020 | 745 | 0,17 | 4,583 % éch. 19/06/2029 | | | |
| Total Qatar | | 317 | 0,07 | 3,250 % éch. 10/03/2028 | 975 810 | 768 | 0,18 | 5,887 % éch. 14/08/2027 | | | |
| ROUMANIE | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | Nationwide Building Society | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | BBVA Consumer Auto | | | | 2,972 % éch. 16/02/2028 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement roumain | | | | 0,270 % éch. 20/07/2031 | € 81 | 88 | 0,02 | NatWest Group PLC | | | |
| 1,375 % éch. 02/12/2029 | € 360 | 328 | 0,08 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,076 % éch. 27/01/2030 | | | |
| 1,750 % éch. 13/07/2030 | 1 300 | 1 165 | 0,27 | Banco Santander S.A. | | | | 1 100 | | | |
| 2,000 % éch. 28/01/2032 | 100 | 86 | 0,02 | 1,849 % éch. 25/03/2026 | \$ 200 | 185 | 0,05 | 1 084 | | | |
| 2,000 % éch. 14/04/2033 | 800 | 663 | 0,15 | 3,496 % éch. 24/03/2025 | 800 | 784 | 0,18 | 1 210 | | | |
| 2,124 % éch. 16/07/2031 | 300 | 265 | 0,06 | Total Corée du Sud | | 11 532 | 2,67 | 2,28 | | | |
| 2,625 % éch. 02/12/2040 | 100 | 74 | 0,02 | ESPAGNE | | | | NatWest Group PLC | | | |
| 2,750 % éch. 14/04/2041 | 200 | 149 | 0,03 | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | 5,076 % éch. 27/01/2030 | | | |
| 2,875 % éch. 13/04/2042 | 500 | 375 | 0,09 | BBVA Consumer Auto | | | | 1 100 | | | |
| 6,375 % éch. 18/09/2033 | 500 | 585 | 0,13 | 0,270 % éch. 20/07/2031 | € 81 | 88 | 0,02 | 1 084 | | | |
| 6,625 % éch. 27/09/2029 | 800 | 947 | 0,22 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 1 084 | | | |
| Total Roumanie | | 4 637 | 1,07 | Banco Santander S.A. | | | | 1 084 | | | |
| RUSSIE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Standard Chartered PLC | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Communauté autonome de Catalogne | | | | 0,991 % éch. 12/01/2025 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement russe | | | | 4,220 % éch. 26/04/2035 | € 300 | 340 | 0,08 | \$ 800 | | | |
| 1,125 % éch. 20/11/2027 ^ | 500 | 224 | 0,05 | Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | | 799 | | | |
| 7,700 % éch. 23/03/2033 ^ | RUB 33 500 | 138 | 0,03 | 1,450 % éch. 31/10/2071 | 500 | 279 | 0,06 | 549 | | | |
| Total Russie | | 362 | 0,08 | 3,450 % éch. 30/07/2066 | 2 000 | 2 072 | 0,48 | 0,13 | | | |
| ARABIE SAOUDITE | | | | SUISSE | | | | 2,678 % éch. 29/06/2032 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,819 % éch. 30/01/2026 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite | | | | Banco Santander S.A. | | | | 400 | | | |
| 3,250 % éch. 22/10/2030 | \$ 200 | 186 | 0,04 | 1,849 % éch. 25/03/2026 | \$ 200 | 185 | 0,05 | 427 | | | |
| 4,750 % éch. 18/01/2028 | 1 200 | 1 214 | 0,28 | 3,496 % éch. 24/03/2025 | 800 | 784 | 0,18 | 2,75 | | | |
| 4,875 % éch. 18/07/2033 | 1 300 | 1 329 | 0,31 | Total Espagne | | 3 748 | 0,87 | 11 879 | | | |
| 5,000 % éch. 18/01/2053 | 900 | 850 | 0,20 | SUPRANATIONALES | | | | TP ICAP Finance PLC | | | |
| Total Arabie saoudite | | 3 579 | 0,83 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,625 % éch. 18/11/2028 | | | |
| SERBIE | | | | THAÏLANDE | | | | 2,625 % éch. 18/11/2028 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Alba PLC | | | |
| Obligation internationale du gouvernement serbe | | | | Communauté autonome de Catalogne | | | | 5,509 % éch. 17/03/2039 | | | |
| 1,650 % éch. 03/03/2033 | € 700 | 574 | 0,14 | 4,220 % éch. 26/04/2035 | € 300 | 340 | 0,08 | 783 | | | |
| 2,050 % éch. 23/09/2036 | 400 | 309 | 0,07 | Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | | 968 | | | |
| 3,125 % éch. 15/05/2027 | 2 500 | 2 647 | 0,61 | 1,450 % éch. 31/10/2071 | 500 | 279 | 0,06 | 684 | | | |
| Total Serbie | | 3 530 | 0,82 | 3,450 % éch. 30/07/2066 | 2 000 | 2 072 | 0,48 | 159 | | | |
| SINGAPOUR | | | | SUISSE | | | | Great Hall Mortgages PLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,469 % éch. 18/03/2039 | | | |
| CapitaLand Ascendas REIT | | | | Banque de développement asiatique | | | | 125 | | | |
| 0,750 % éch. 23/06/2028 | 1 000 | 948 | 0,22 | 6,150 % éch. 25/02/2030 | INR 252 300 | 2 905 | 0,67 | 159 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | SUISSE | | | | 5,479 % éch. 18/06/2039 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 120 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | UBS Group AG | | | | 152 | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | 4,125 % éch. 24/09/2025 | \$ 200 | 196 | 0,05 | 81 | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | 6,327 % éch. 22/12/2027 | 300 | 309 | 0,07 | 82 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | THAÏLANDE | | | | Paragon Mortgages PLC | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | 6,373 % éch. 15/07/2026 | 500 | 506 | 0,12 | 6,270 % éch. 15/05/2045 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | 6,537 % éch. 12/08/2033 | 300 | 320 | 0,07 | £ 88 | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | 7,000 % éch. 30/09/2027 | £ 300 | 399 | 0,09 | 112 | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 1 900 | 2 422 | 0,56 | 594 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | THAÏLANDE | | | | Resloc UK PLC | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | 9,016 % éch. 15/11/2033 | \$ 500 | 615 | 0,14 | 549 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | Total Suisse | | 4 767 | 1,10 | 549 | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | THAÏLANDE | | | | Ripon Mortgages PLC | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,920 % éch. 28/08/2056 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | THAÏLANDE | | | | 0,000 % éch. 15/02/2047 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | 3,390 % éch. 17/06/2037 | THB 30 641 | 951 | 0,22 | 1 918 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | RMAC Securities PLC | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,509 % éch. 12/06/2044 | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. | | | | 508 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | THAÏLANDE | | | | Stratton Mortgage Funding PLC | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | 4,875 % éch. 25/07/2033 | \$ 1 800 | 1 787 | 0,41 | 6,069 % éch. 25/09/2051 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | 6,120 % éch. 12/03/2052 | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,121 % éch. 20/07/2060 | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | THAÏLANDE | | | | 1 104 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | THAÏLANDE | | | | Towd Point Mortgage Funding PLC | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | 3,390 % éch. 17/06/2037 | THB 30 641 | 951 | 0,22 | 832 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | Trinity Square PLC | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,070 % éch. 15/07/2059 | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | THAÏLANDE | | | | 509 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | THAÏLANDE | | | | 14 038 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | 3,390 % éch. 17/06/2037 | THB 30 641 | 951 | 0,22 | 3,25 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | Bon du Trésor britannique | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 0,125 % éch. 22/03/2024 (e) | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | THAÏLANDE | | | | 5 611 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | THAÏLANDE | | | | 0,125 % éch. 22/03/2051 (e) | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | 3,390 % éch. 17/06/2037 | THB 30 641 | 951 | 0,22 | 295 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | 0,125 % éch. 22/03/2068 (e) | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 166 | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | THAÏLANDE | | | | 178 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | THAÏLANDE | | | | 0,625 % éch. 22/11/2042 (e) | | | |
| Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | | 3,390 % éch. 17/06/2037 | THB 30 641 | 951 | 0,22 | 1 300 | | | |
| 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 890 | 641 | 0,15 | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | 0,625 % éch. 22/10/2050 | | | |
| 3,375 % éch. 01/09/2033 | 260 | 209 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 732 | | | |
| Total Singapour | | 1 798 | 0,42 | THAÏLANDE | | | | 0,17 | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|---|---|-------------------------------------|------------------------------|------|
| 1,250 % éch. 31/07/2051 | £ 370 | \$ 251 | 0,06 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | \$ 241 | \$ 205 | 0,05 | |
| 1,500 % éch. 31/07/2053 | 300 | 213 | 0,05 | 7-Eleven, Inc. | \$ 100 | \$ 99 | 0,02 | GSR Mortgage Loan Trust | | | | |
| | | 8 964 | 2,07 | 0,800 % éch. 10/02/2024 | | | | 5,750 % éch. 25/02/2036 | 143 | 125 | 0,03 | |
| Total Royaume-Uni | | 34 881 | 8,07 | Ally Financial, Inc. | 400 | 401 | 0,09 | HarborView Mortgage Loan Trust | 161 | 71 | 0,02 | |
| | | | | American Tower Corp. | 500 | 475 | 0,11 | 4,082 % éch. 19/06/2036 | | | | |
| ÉTATS-UNIS | | | | 3,800 % éch. 15/08/2029 | | | | Lehman XS Trust | 185 | 163 | 0,04 | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | Bank of America Corp. | € 700 | 751 | 0,17 | Morgan Stanley Capital Trust | 1 300 | 1 289 | 0,30 | |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | \$ 85 | 66 | 0,01 | 1,949 % éch. 27/10/2026 | \$ 600 | 584 | 0,14 | Residential Accredited Loans, Inc. Trust | 255 | 196 | 0,04 | |
| 5,750 % éch. 25/07/2036 | 107 | 105 | 0,02 | 3,384 % éch. 02/04/2026 | € 600 | 666 | 0,15 | 6,000 % éch. 25/06/2036 | 274 | 117 | 0,03 | |
| 6,070 % éch. 25/02/2036 | 157 | 160 | 0,04 | 4,962 % éch. 24/08/2025 | \$ 400 | 390 | 0,09 | 6,000 % éch. 25/09/2036 | | | | |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | 5 | 5 | 0,00 | Bayer U.S. Finance LLC | 4,250 % éch. 15/12/2025 | | | Residential Asset Securitization Trust | 930 | 706 | 0,16 | |
| 4,724 % éch. 25/07/2036 | | | | Charter Communications Operating LLC | 2,250 % éch. 15/01/2023 | 300 | 260 | 0,06 | 5,750 % éch. 25/02/2036 | | | |
| Carrington Mortgage Loan Trust | 1 100 | 778 | 0,18 | 3,950 % éch. 30/06/2026 | 800 | 504 | 0,12 | Sequoia Mortgage Trust | 15 | 9 | 0,00 | |
| 5,690 % éch. 25/01/2037 | | | | 5,125 % éch. 01/07/2049 | 500 | 407 | 0,09 | 3,701 % éch. 20/01/2047 | | | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust | 494 | 475 | 0,11 | Credit Suisse AG AT1 Claim | 300 | 36 | 0,01 | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | 60 | 32 | 0,01 | |
| 4,254 % éch. 25/10/2037 | | | | Doctors Co. An Interinsurance Exchange | 4,500 % éch. 18/01/2032 | 100 | 80 | 0,02 | 4,471 % éch. 25/10/2036 | 140 | 128 | 0,03 |
| 5,990 % éch. 25/03/2036 | 1 001 | 901 | 0,21 | Ford Motor Credit Co. LLC | 2,748 % éch. 14/06/2024 | € 100 | 126 | 0,03 | 5,790 % éch. 25/10/2035 | 25 | 21 | 0,00 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | 762 | 686 | 0,16 | 3,375 % éch. 13/11/2025 | \$ 500 | 479 | 0,11 | 5,910 % éch. 25/05/2037 | | | | |
| 5,610 % éch. 25/08/2037 | 228 | 205 | 0,05 | 3,664 % éch. 08/09/2024 | 200 | 197 | 0,05 | Structured Asset Mortgage Investments Trust | 407 | 336 | 0,08 | |
| 5,610 % éch. 25/06/2047 | 948 | 849 | 0,20 | 5,125 % éch. 16/06/2025 | 500 | 494 | 0,11 | 5,830 % éch. 25/07/2046 | 190 | 150 | 0,03 | |
| 5,670 % éch. 25/06/2047 | 1 267 | 1 149 | 0,27 | GA Global Funding Trust | 2,250 % éch. 06/01/2027 | 300 | 273 | 0,06 | 5,870 % éch. 25/05/2036 | 13 | 12 | 0,00 |
| 5,930 % éch. 25/04/2047 | 2 765 | 2 579 | 0,60 | Goldman Sachs Group, Inc. | 3,615 % éch. 15/03/2028 | 100 | 96 | 0,02 | 5,890 % éch. 25/04/2036 | 2 | 1 | 0,00 |
| 5,990 % éch. 25/12/2036 | | | | 4,452 % éch. 30/04/2024 | € 800 | 884 | 0,21 | 6,310 % éch. 19/10/2033 | | | | |
| First Franklin Mortgage Loan Trust | 99 | 91 | 0,02 | 4,956 % éch. 07/02/2025 | 500 | 553 | 0,13 | Structured Asset Securities Corp. | 135 | 112 | 0,03 | |
| 6,190 % éch. 25/11/2035 | | | | JPMorgan Chase & Co. | 2,595 % éch. 24/02/2026 | \$ 1 300 | 1 260 | 0,29 | 5,750 % éch. 25/01/2036 | 483 | 388 | 0,09 |
| First NLC Trust | 383 | 190 | 0,04 | 4,080 % éch. 26/04/2026 | 1 300 | 1 279 | 0,30 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | 483 | 388 | 0,09 | |
| 5,540 % éch. 25/08/2037 | | | | Morgan Stanley | 2,103 % éch. 08/05/2026 | € 1 000 | 1 080 | 0,25 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | 56 | 48 | 0,01 |
| GSAMP Trust | 181 | 90 | 0,02 | Organon & Co. | 2,875 % éch. 30/04/2028 | 100 | 102 | 0,02 | 4,063 % éch. 25/12/2036 | 123 | 111 | 0,03 |
| 5,620 % éch. 25/12/2046 | 91 | 45 | 0,01 | Pacific Gas & Electric Co. | 2,100 % éch. 01/08/2027 | \$ 100 | 90 | 0,02 | 6,030 % éch. 25/11/2045 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,700 % éch. 25/12/2046 | 3 036 | 1 082 | 0,25 | 3,150 % éch. 01/01/2026 | 100 | 96 | 0,02 | 6,412 % éch. 25/06/2042 | | | | |
| 5,950 % éch. 25/09/2036 | | | | 3,450 % éch. 01/07/2025 | 100 | 97 | 0,02 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through | 381 | 337 | 0,08 | |
| Home Equity Asset Trust | 344 | 339 | 0,08 | 3,950 % éch. 01/12/2046 | 100 | 73 | 0,02 | Certificates Trust | | | | |
| 6,565 % éch. 25/05/2035 | | | | 4,000 % éch. 01/12/2046 | 100 | 73 | 0,02 | 6,000 % éch. 25/06/2037 | 8 509 | 1 97 | | |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust | 198 | 52 | 0,01 | 4,500 % éch. 01/07/2040 | 100 | 85 | 0,02 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN | | | | |
| 6,085 % éch. 25/01/2036 | 2 300 | 2 123 | 0,49 | 4,550 % éch. 01/07/2030 | 100 | 95 | 0,02 | Fannie Mae | 391 | 345 | 0,08 | |
| Long Beach Mortgage Loan Trust | 20 | 20 | 0,00 | Penske Truck Leasing Co. LP | 3,950 % éch. 10/03/2025 | 1 400 | 1 375 | 0,32 | 3,000 % éch. 01/03/2060 | 1 233 | 1 120 | 0,26 |
| 6,115 % éch. 25/11/2035 | | | | Principal Life Global Funding | 1,375 % éch. 10/01/2025 | 300 | 288 | 0,07 | 3,500 % éch. 01/01/2059 | 15 | 15 | 0,01 |
| Massachusetts Educational Financing Authority | 29 | 29 | 0,01 | Southern California Edison Co. | 1,100 % éch. 01/04/2024 | 300 | 297 | 0,07 | 5,852 % éch. 25/06/2036 | | | |
| 6,590 % éch. 25/04/2038 | | | | 14 045 | 3,25 | | | Freddie Mac | 225 | 12 | 0,00 | |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust | 250 | 238 | 0,05 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | 0,000 % éch. 15/01/2038 (a) | 225 | 222 | 0,05 | |
| 5,680 % éch. 25/05/2037 | 278 | 107 | 0,02 | CenturyLink, Inc. | 7,720 % éch. 15/03/2027 | 591 | 410 | 0,09 | 5,334 % éch. 15/01/2038 | 274 | 272 | 0,06 |
| 5,770 % éch. 25/08/2036 | 3 511 | 1 283 | 0,30 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | Ginnie Mae | 2 700 | 2 447 | 0,57 | |
| 5,950 % éch. 25/06/2036 | | | | Ashford Hospitality Trust | 6,434 % éch. 15/04/2035 | 1 051 | 1 038 | 0,24 | 3,000 % éch. 01/02/2054 | 6 100 | 5 197 | 1,20 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | 633 | 551 | 0,13 | 6,534 % éch. 15/06/2035 | 304 | 300 | 0,07 | 3,500 % éch. 01/01/2054 | 1 800 | 1 653 | 0,38 | |
| 5,600 % éch. 25/01/2037 | 1 871 | 831 | 0,19 | Banc of America Funding Trust | 5,852 % éch. 20/10/2036 | 44 | 33 | 0,01 | 4,000 % éch. 01/09/2040 - | 17 800 | 16 841 | 3,90 |
| 5,720 % éch. 25/03/2037 | 686 | 294 | 0,07 | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust | 6,659 % éch. 15/07/2037 | 1 361 | 1 340 | 0,31 | 01/07/2050 | 21 800 | 21 147 | 4,89 |
| 5,950 % éch. 25/06/2036 | 1 311 | 690 | 0,16 | Chase Mortgage Finance Trust | 4,523 % éch. 25/07/2037 | 37 | 30 | 0,01 | 4,000 % éch. 01/06/2050 | 29 600 | 29 298 | 6,78 |
| New Century Home Equity Loan Trust | 377 | 370 | 0,08 | Citigroup Commercial Mortgage Trust | 3,251 % éch. 10/05/2035 | 946 | 894 | 0,21 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 23 300 | 23 405 | 5,42 |
| 6,190 % éch. 25/03/2035 | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | 3,906 % éch. 25/05/2035 | 20 | 19 | 0,00 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 24 300 | 24 675 | 5,71 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust | 194 | 81 | 0,02 | Countrywide Alternative Loan Trust | 5,892 % éch. 20/03/2046 | 19 | 16 | 0,00 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 39 700 | 40 682 | 9,41 |
| 5,770 % éch. 25/09/2036 | | | | 5,892 % éch. 20/05/2046 | 23 | 20 | 0,00 | 6,500 % éch. 01/02/2054 | | | | |
| Option One Mortgage Loan Trust | 300 | 265 | 0,06 | 6,000 % éch. 25/03/2036 | 375 | 169 | 0,04 | | 171 779 | 39,74 | | |
| 5,610 % éch. 25/03/2037 | | | | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 197 | 92 | 0,02 | | | | | |
| RAAC Trust | 388 | 372 | 0,09 | | | | | | | | | |
| 6,970 % éch. 25/09/2047 | | | | | | | | | | | | |
| Residential Asset Mortgage Products Trust | 310 | 287 | 0,07 | | | | | | | | | |
| 6,110 % éch. 25/01/2036 | 1 300 | 1 119 | 0,26 | | | | | | | | | |
| 6,520 % éch. 25/09/2035 | 51 | 50 | 0,01 | | | | | | | | | |
| Residential Asset Securities Corp. Trust | 593 | 474 | 0,11 | | | | | | | | | |
| 6,030 % éch. 25/04/2036 | 30 | 27 | 0,01 | | | | | | | | | |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | 397 | 208 | 0,05 | | | | | | | | | |
| 5,970 % éch. 25/05/2036 | 1 872 | 1 723 | 0,40 | | | | | | | | | |
| 6,130 % éch. 25/08/2035 | 9 | 8 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 6,430 % éch. 25/01/2036 | | | | | | | | | | | | |
| Soundview Home Loan Trust | 474 | 455 | 0,10 | | | | | | | | | |
| 6,030 % éch. 25/05/2036 | | | | | | | | | | | | |
| Structured Asset Investment Loan Trust | 20 | 20 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 5,620 % éch. 25/09/2036 | 1 872 | 1 723 | 0,40 | | | | | | | | | |
| 6,090 % éch. 25/01/2036 | 9 | 8 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 6,520 % éch. 25/08/2033 | | | | | | | | | | | | |
| Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. | 200 | 204 | 0,05 | | | | | | | | | |
| 5,102 % éch. 01/04/2035 | | | | | | | | | | | | |
| | | 21 676 | 5,01 | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | BONS DU TRÉSOR ARGENTIN | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| Obligations du Trésor américain | | | | 3,500 % éch. 15/02/2033 | 1 300 | 1 261 | 0,29 | (0,189) % éch. | | | |
| 1,625 % éch. 15/11/2050 | \$ 1 300 | \$ 775 | 0,18 | 4,000 % éch. 29/02/2028 | 300 | 301 | 0,07 | 05/02/2024 (c)(d) | 292 000 | 2 071 | 0,48 |
| 1,875 % éch. 15/02/2041 | 9 000 | 6 475 | 1,50 | | | 52 347 | 12,11 | | | 13 905 | 3,22 |
| 2,875 % éch. 15/05/2052 | 300 | 239 | 0,05 | Total États-Unis | | 268 766 | 62,17 | Total des Instruments à court terme | | 19 027 | 4,40 |
| 4,000 % éch. 15/11/2052 | 400 | 395 | 0,09 | | | | | Total des Valeurs mobilières | | \$ 558 153 129,12 | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e) | | | | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | PIMCO Select Funds plc - | | | |
| 0,125 % éch. 15/04/2025 | 3 157 | 3 044 | 0,70 | 10,900 % éch. | | | | Fonds PIMCO | | | |
| 0,125 % éch. 15/07/2030 | 2 040 | 1 844 | 0,43 | 04/01/2024 (c)(d) | HUF 1 771 000 | 5 115 | 1,18 | US Dollar Short-Term | 1 218 209 | \$ 12 139 | 2,81 |
| 0,125 % éch. 15/07/2031 | 1 263 | 1 123 | 0,26 | BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | | Floating NAV Fund (g) | | | |
| 0,125 % éch. 15/01/2032 | 3 996 | 3 512 | 0,81 | (0,211) % éch. | | | | PIMCO Specialty Funds | | | |
| 0,250 % éch. 15/01/2025 | 6 755 | 6 557 | 1,52 | 29/01/2024 (c)(d) | ¥ 202 000 | 1 433 | 0,33 | Ireland p.l.c. - Fonds | | | |
| 0,250 % éch. 15/02/2050 | 1 197 | 781 | 0,18 | (0,207) % éch. | | | | PIMCO China Bond | 446 527 | 6 071 | 1,40 |
| 0,500 % éch. 15/01/2028 | 10 228 | 9 681 | 2,24 | 05/02/2024 (c)(d) | 1 428 000 | 10 131 | 2,35 | Fund (g) | | | |
| 0,625 % éch. 15/07/2032 | 1 694 | 1 549 | 0,36 | (0,193) % éch. | | | | Total des Fonds d'investissement | | \$ 18 210 | 4,21 |
| 0,750 % éch. 15/07/2028 | 2 084 | 1 995 | 0,46 | 29/01/2024 (c)(d) | 38 000 | 270 | 0,06 | | | | |
| 1,125 % éch. 15/01/2033 | 3 925 | 3 716 | 0,86 | | | | | | | | |
| Billets du Trésor américain | | | | | | | | | | | |
| 2,875 % éch. 30/04/2025 | 9 300 | 9 099 | 2,11 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 534 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | \$ (545) | \$ 534 | \$ 534 | 0,12 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (545) | \$ 534 | \$ 534 | 0,12 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois mars | Long | 03/2024 | 154 | \$ 26 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois mars | Long | 03/2025 | 154 | 139 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Court | 09/2024 | 308 | (203) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 7 | (33) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2025 | 326 | (427) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2024 | 25 | (3) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Long | 09/2025 | 82 | 122 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Long | 06/2024 | 276 | 112 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2024 | 87 | (56) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Long | 12/2025 | 82 | 122 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars | Court | 03/2024 | 28 | (20) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 136 | (317) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 6 | 22 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 55 | (118) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 5 | (63) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 149 | (666) | (0,15) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 14 | (10) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 16 | (138) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 10 | (21) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 229 | (619) | (0,14) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 94 | (332) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 67 | (381) | (0,09) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 24 | (222) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 3 | 37 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 220 | (1 971) | (0,46) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (5 020) | (1,16) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,00 % | 20/06/2025 | \$ 400 | \$ 8 | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-40 Index à 10 ans | (1,000) % | 20/06/2033 | \$ 4 600 | \$ (47) | (0,01) |
| Indice CDX.IG-41 Index à 10 ans | (1,000) | 20/12/2033 | 56 300 | (652) | (0,15) |
| Indice iTraxx Europe Main 40 Index à 10 ans | (1,000) | 20/12/2033 | € 6 500 | (92) | (0,02) |
| | | | | \$ (791) | (0,18) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-40 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/06/2028 | \$ 500 | \$ 3 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 54 800 | 376 | 0,09 |
| | | | | \$ 379 | 0,09 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,000 % | 17/06/2027 | £ 11 700 | \$ 28 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 17/06/2035 | 2 500 | (6) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 800 | 133 | 0,03 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 25 800 | 2 708 | 0,63 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 18 700 | 714 | 0,16 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 900 | 29 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,250 | 20/03/2029 | INR 109 640 | 2 | 0,00 |
| À payer | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2029 | 602 600 | 21 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2034 | 56 810 | (4) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/12/2028 | ¥ 250 000 | (34) | (0,01) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 17/03/2031 | 230 000 | (57) | (0,01) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050 | 15/12/2031 | 440 000 | (68) | (0,02) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 19/06/2039 | 280 000 | 251 | 0,06 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,550 | 14/09/2028 | 570 000 | (56) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,789 | 23/01/2033 | 1 356 000 | (81) | (0,02) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,800 | 15/06/2052 | 300 000 | 298 | 0,07 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,850 | 20/09/2033 | 130 000 | (4) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 20/03/2029 | SGD 11 645 | (82) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2027 | \$ 10 400 | 844 | 0,19 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2029 | 10 080 | (492) | (0,11) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,249 | 31/08/2024 | 9 500 | 465 | 0,11 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/12/2026 | 10 200 | 933 | 0,21 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,298 | 25/08/2024 | 8 100 | 406 | 0,09 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,430 | 31/03/2024 | 200 | 6 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 18/12/2024 | 200 | 14 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 9 900 | (1 182) | (0,27) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,518 | 20/01/2029 | 800 | (86) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 20/01/2029 | 2 300 | (234) | (0,05) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 26/01/2029 | 500 | (50) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2024 | 10 740 | 72 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2027 | 19 230 | 265 | 0,06 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,850 | 21/04/2024 | 21 900 | 522 | 0,12 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/12/2051 | 2 000 | (753) | (0,17) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,209 | 31/03/2024 | 2 236 | 71 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,400 | 21/06/2024 | 600 | (17) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 1 080 | (74) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 400 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 900 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 1 200 | (18) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,965 | 30/11/2026 | 16 400 | 400 | 0,09 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,968 | 30/06/2024 | 13 100 | (307) | (0,07) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 600 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | 400 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 500 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,070 | 15/11/2032 | 2 500 | 83 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,083 | 15/11/2032 | 2 300 | 74 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,086 | 15/11/2032 | 2 600 | 56 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 % | 07/11/2024 | \$ 300 | \$ (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100 | 09/09/2029 | 600 | (13) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,106 | 15/11/2032 | 1 900 | 57 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,139 | 15/11/2032 | 2 400 | 66 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 600 | (7) | 0,00 |
| À recevoir(4) | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,150 | 13/05/2025 | 32 800 | 229 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,163 | 30/09/2029 | 3 100 | (72) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,173 | 15/11/2032 | 1 700 | 44 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,174 | 15/11/2032 | 1 800 | 45 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 600 | (7) | 0,00 |
| À recevoir(4) | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,200 | 13/05/2025 | 2 700 | 25 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,203 | 05/10/2053 | 220 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 500 | (5) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 30/09/2029 | 2 100 | (43) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,240 | 03/10/2053 | 600 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 7 400 | 38 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 9 600 | (1 160) | (0,27) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,454 | 30/06/2029 | 2 900 | (37) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 31 271 | 1 208 | 0,28 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 1 000 | (9) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 1 300 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 1 600 | (13) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 900 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 9 600 | 134 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 11 104 | (354) | (0,08) |
| À recevoir(4) | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 150 | (3) | 0,00 |
| À payer(4) | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2034 | 8 620 | 22 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 200 | 3 | 0,00 |
| À recevoir(4) | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 150 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 400 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 600 | (17) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,857 | 31/03/2030 | 4 000 | 59 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,898 | 30/06/2029 | 3 200 | 37 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 500 | (18) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,981 | 30/11/2027 | 8 600 | 103 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,988 | 30/11/2027 | 9 200 | 238 | 0,05 |
| À recevoir(4) | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 | 20/03/2054 | 1 600 | (29) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 500 | (21) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,159 | 31/03/2025 | 14 500 | 209 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,193 | 30/11/2027 | 3 000 | 60 | 0,01 |
| À recevoir(4) | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,228 | 30/08/2025 | 5 300 | (22) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 54 396 | (215) | (0,05) |
| À payer(4) | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2034 | 7 200 | 73 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 310 | 26 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 1 100 | 92 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 600 | 50 | 0,01 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 6,291 | 04/01/2027 | BRL 1 600 | 29 | 0,01 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,220 | 03/03/2025 | CAD 6 700 | (288) | (0,07) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2025 | 2 600 | (112) | (0,03) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2030 | 1 600 | (90) | (0,02) |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,750 | 16/12/2046 | 1 400 | 122 | 0,03 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,900 | 18/12/2029 | 3 700 | (243) | (0,06) |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 3,250 | 15/03/2033 | 1 900 | 26 | 0,01 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 21/06/2033 | 5 700 | 174 | 0,04 |
| À recevoir | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 21/06/2053 | 2 400 | (146) | (0,03) |
| À payer(4) | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 10/05/2025 | 45 500 | (73) | (0,02) |
| À recevoir | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2033 | 4 600 | (176) | (0,04) |
| À payer(4) | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,600 | 30/08/2025 | 6 700 | 47 | 0,01 |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,283 | 14/02/2027 | CHF 1 700 | (73) | (0,02) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,294 | 10/02/2027 | 4 400 | (178) | (0,04) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,300 | 15/02/2027 | 1 700 | (72) | (0,02) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,343 | 16/05/2027 | 1 300 | (51) | (0,01) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,500 | 15/09/2026 | 900 | (45) | (0,01) |
| À recevoir(4) | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | CNY 80 920 | (64) | (0,02) |
| À payer(4) | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,250 | 20/03/2029 | KRW 1 508 010 | 6 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 0,528 | 17/03/2024 | NZD 350 | (1) | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 3,250 | 21/03/2028 | 2 600 | (252) | (0,06) |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 3,750 | 15/06/2027 | 4 100 | 20 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 4,000 | 14/06/2024 | 24 900 | (80) | (0,02) |
| À payer(4) | BBR NZD à 3 mois | 4,750 | 20/03/2025 | 12 400 | (15) | 0,00 |
| À payer(4) | BBR NZD à 3 mois | 5,250 | 20/03/2025 | 11 700 | 20 | 0,00 |
| À payer | STIBOR SEK à 3 mois | 0,500 | 19/06/2024 | SEK 12 700 | (35) | (0,01) |
| À payer | STIBOR SEK à 3 mois | 1,000 | 19/06/2029 | 16 100 | (145) | (0,03) |
| À recevoir | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,250 | 17/06/2030 | AUD 5 700 | 466 | 0,11 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,750 | 16/03/2027 | 1 900 | (90) | (0,02) |
| À recevoir | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,750 | 16/06/2031 | 1 750 | 176 | 0,04 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,000 | 21/06/2033 | 14 600 | 109 | 0,02 |
| À payer(4) | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 15/09/2032 | 1 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 15/03/2033 | 12 400 | (88) | (0,02) |
| À payer(4) | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 15/09/2032 | 22 500 | 143 | 0,03 |
| À payer(4) | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | 28 700 | 401 | 0,09 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,054 % | 27/05/2050 | € 200 | \$ 52 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,064 | 17/11/2052 | 500 | 168 | 0,04 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,450 | 15/12/2035 | 300 | 73 | 0,02 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | 500 | (17) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | 1 400 | (90) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 900 | (54) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 700 | (44) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 1 600 | (79) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 700 | (34) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | 3 900 | 10 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 8 800 | 25 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 1 800 | 5 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 26/04/2024 | 1 300 | 7 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 1 300 | 6 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 1 200 | 6 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 21/09/2037 | 1 400 | 18 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 16 200 | (1 846) | (0,43) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 200 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 100 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 400 | (15) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 100 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 600 | (15) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 100 | (4) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 19/03/2027 | 17 660 | 223 | 0,05 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 15/03/2033 | 7 860 | (104) | (0,02) |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 54 510 | 3 187 | 0,74 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 100 | (5) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 37 100 | 1 182 | 0,27 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 1 200 | (45) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 300 | (21) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 500 | 39 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 400 | (29) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 1 600 | 73 | 0,02 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 22 100 | 312 | 0,07 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,536 | 18/09/2025 | 26 000 | (275) | (0,06) |
| À recevoir | NIBOR NOK à 6 mois | 1,635 | 18/03/2025 | NOK 6 200 | 32 | 0,01 |
| À recevoir | NIBOR NOK à 6 mois | 1,993 | 12/11/2024 | NOK 4 200 | 25 | 0,01 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 4,870 | 07/07/2025 | MXN 41 500 | (83) | (0,02) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,080 | 26/02/2025 | 10 500 | (33) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,380 | 25/02/2025 | 12 300 | (42) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,415 | 25/02/2025 | 300 | (1) | 0,00 |
| | | | | | \$ 7 491 | 1,73 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 7 087 | 1,64 |

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 % | 15/07/2024 | 8 600 | \$ 17 | \$ 6 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,180 | 11/01/2024 | 1 900 | 54 | 203 | 0,04 |
| BRC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 10 500 | 14 | 0 | 0,00 |
| DUB | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 | 10/07/2024 | 37 800 | 103 | 27 | 0,01 |
| FAR | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 11 300 | 17 | 0 | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 11 100 | 17 | 0 | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 13 000 | 17 | 1 | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 12 200 | 17 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ 256 | \$ 238 | 0,05 |

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| BPS | Option de vente - Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052 hors cote | € 97,000 | 23/05/2025 | 800 | \$ 61 | \$ 328 | 0,08 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM | Option de vente - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 04/03/2024 | 580 | \$ (8) | \$ (17) | (0,01) |
| JPM | Option de vente - USD contre TWD hors cote | 31,000 | 01/03/2024 | 1 401 | (19) | (40) | (0,01) |
| | | | | | \$ (27) | \$ (57) | (0,02) |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,310 % | 11/01/2024 | 16 900 | \$ (55) | \$ (392) | (0,09) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 5,250 | 15/07/2024 | 8 600 | (9) | (2) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 300 | (1) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 0,451 | 23/05/2025 | 800 | (61) | (304) | (0,07) |
| DUB | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,790 | 08/04/2024 | 1 700 | (13) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,790 | 08/04/2024 | 1 700 | (13) | (25) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 5,250 | 10/07/2024 | 37 800 | (57) | (9) | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 400 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 400 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 2 000 | (16) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 2 000 | (16) | (32) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 | 08/04/2024 | 600 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 600 | (5) | (9) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 500 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 500 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 600 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 300 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 300 | (1) | (4) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 500 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 500 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 600 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 300 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR GBP à 6 mois | À recevoir | 0,820 | 16/12/2024 | 4 600 | (33) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 500 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 500 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 900 | (3) | (14) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 900 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 300 | (1) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (325) | \$ (832) | (0,19) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 1 000 | \$ (29) | \$ (4) | \$ (33) | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) | 20/12/2028 | 1 000 | (29) | (5) | (34) | (0,01) |
| | | | | | \$ (58) | \$ (9) | \$ (67) | (0,01) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 % | 20/06/2025 | \$ 500 | \$ (12) | \$ 18 | \$ 6 | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 | 20/06/2025 | 400 | (10) | 14 | 4 | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 | 20/06/2025 | 500 | (12) | 18 | 6 | 0,00 |
| | | | | | \$ (34) | \$ 50 | \$ 16 | 0,00 |

- (1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notional du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notional du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notional du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notional du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVICES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notional de la devise reçue | Montant notional de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|---|-----------------|-------------------------------------|--------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| AZD | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,290 % sur la base du montant notional de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notional de la devise livrée | 04/01/2031 | AUD 700 | \$ 527 | \$ 3 | \$ (1) | \$ 2 | 0,00 |
| CBK | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,420 % sur la base du montant notional de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notional de la devise livrée | 31/07/2029 | 5 900 | 4 071 | (1) | 18 | 17 | 0,01 |
| GLM | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,423 % sur la base du montant notional de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notional de la devise livrée | 01/08/2029 | 5 600 | 3 864 | (11) | 18 | 7 | 0,00 |
| | | | | | | \$ (9) | \$ 35 | \$ 26 | 0,01 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notional | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/09/2028 | MYR 3 320 | \$ 17 | \$ (15) | \$ 2 | 0,00 |
| GST | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/09/2028 | 32 480 | 121 | (99) | 22 | 0,01 |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,600 | 20/09/2028 | 4 230 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,750 | 20/09/2033 | 13 530 | 86 | (64) | 22 | 0,01 |
| JPM | À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 5,960 | 11/02/2029 | COP 15 800 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 224 | \$ (179) | \$ 45 | 0,01 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 694 | AUD 1 048 | \$ 21 | \$ 0 | \$ 21 | 0,01 |
| | 03/2024 | 1 719 | CNH 12 391 | 31 | 0 | 31 | 0,01 |
| BOA | 01/2024 | COP 2 851 625 | \$ 746 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 659 | 836 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN 3 691 | 995 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 368 | AUD 556 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | 709 | COP 2 851 625 | 26 | 0 | 26 | 0,01 |
| | 01/2024 | 7 378 | ¥ 1 088 722 | 350 | 0 | 350 | 0,08 |
| | 01/2024 | 448 | NOK 4 762 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 01/2024 | 854 | NZD 1 401 | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| | 02/2024 | 8 586 | CNY 60 682 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 1 569 517 | \$ 100 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 2 113 | CNH 15 305 | 49 | 0 | 49 | 0,01 |
| | 03/2024 | 735 | COP 2 851 625 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 03/2024 | 47 | INR 3 947 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | 340 | KZT 171 575 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| | 06/2024 | KRW 64 801 | \$ 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | DKK 25 830 | 3 810 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 1 230 | 1 342 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 1 468 | 1 863 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 62 063 | 177 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 130 724 | 100 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN 323 | 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 674 | AUD 1 000 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | 256 | BRL 1 252 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 083 | € 3 745 | 55 | 0 | 55 | 0,01 |
| | 01/2024 | 4 | HUF 1 426 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 50 | IDR 773 309 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|-------|--------|
| | 01/2024 | \$ | 2 483 | ZAR | 46 025 | \$ 31 | \$ 0 | \$ 31 | 0,01 |
| | 02/2024 | CNY | 30 | \$ | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 19 350 | | 609 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ | 15 245 | CNY | 108 220 | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH | 15 792 | \$ | 2 176 | 0 | (54) | (54) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR | 5 320 995 | | 347 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR | 91 173 | | 1 093 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 15 745 | | 501 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 3 134 | CNH | 22 574 | 54 | 0 | 54 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 276 | IDR | 4 255 165 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 164 | INR | 13 711 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 15 | THB | 538 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 1 793 286 | \$ | 1 373 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| BRC | 01/2024 | | 129 230 | | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 167 | PLN | 9 474 | 242 | 0 | 242 | 0,06 |
| | 01/2024 | | 99 | ZAR | 1 849 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 5 631 | \$ | 792 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 50 | IDR | 776 911 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 | THB | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 1 775 575 | \$ | 1 360 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| CBK | 01/2024 | AUD | 312 | | 211 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL | 45 762 | | 9 398 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 01/2024 | CHF | 1 625 | | 1 873 | 0 | (59) | (59) | (0,01) |
| | 01/2024 | DKK | 3 120 | | 454 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 2 802 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR | 771 427 | | 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 379 100 | | 2 685 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 1 096 | | 60 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 496 | AUD | 737 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 481 | £ | 380 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 296 | MXN | 5 220 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 108 | NOK | 1 152 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 128 | PLN | 515 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 260 | BRL | 1 278 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 20 502 | \$ | 2 891 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNY | 1 954 | | 275 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 1 220 | | 324 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 596 | BRL | 2 950 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 896 | CNH | 6 406 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 416 | IDR | 22 295 057 | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| | 04/2024 | | 9 136 | BRL | 44 935 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| | 04/2024 | | 1 038 | VND | 25 691 912 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| | 06/2024 | KRW | 960 756 | \$ | 745 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | HUF | 71 734 | | 193 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 52 | CNY | 369 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 011 | CNH | 7 284 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 969 | SGD | 1 283 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 1 919 550 | \$ | 1 475 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | AUD | 707 | | 474 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK | 34 220 | | 5 048 | 0 | (25) | (25) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 8 630 | BRL | 43 477 | 320 | 0 | 320 | 0,07 |
| | 01/2024 | | 3 598 | CHF | 3 153 | 150 | 0 | 150 | 0,03 |
| | 01/2024 | | 445 | £ | 349 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 8 633 | MXN | 151 401 | 267 | 0 | 267 | 0,06 |
| | 01/2024 | | 1 060 | PLN | 4 246 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 16 517 | \$ | 2 290 | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 656 | CNH | 4 736 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 372 | IDR | 5 706 207 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 310 | TWD | 9 607 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | HUF | 155 620 | \$ | 443 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 100 | IDR | 1 538 700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 50 | KRW | 64 807 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | 50 028 | \$ | 6 965 | 0 | (108) | (108) | (0,03) |
| | 02/2024 | \$ | 422 | BRL | 2 072 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 16 775 | INR | 1 401 374 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| | 03/2024 | IDR | 4 788 647 | \$ | 309 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 19 486 | | 627 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 579 | CNH | 4 145 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 49 | INR | 4 110 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 700 | TWD | 21 715 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 2 103 169 | \$ | 1 620 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 10/2024 | ¥ | 110 000 | | 890 | 78 | 0 | 78 | 0,02 |
| MBC | 01/2024 | CAD | 4 884 | | 3 609 | 0 | (95) | (95) | (0,02) |
| | 01/2024 | ¥ | 234 600 | | 1 646 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 326 | AUD | 492 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 025 | DKK | 7 080 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 1 106 | € | 1 011 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 376 | HUF | 137 894 | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| | 02/2024 | CNY | 2 049 | \$ | 284 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 495 | CNY | 3 568 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 25 348 | \$ | 3 500 | 0 | (80) | (80) | (0,02) |
| | 03/2024 | TWD | 487 | | 15 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| | 03/2024 | \$ | 506 CNH | 3 601 | \$ 3 | \$ 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 005 PHP | 56 229 | 10 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 10/2024 | ¥ | 340 000 \$ | 2 725 | 217 | 0 | 0,05 | |
| | 01/2024 | DKK | 1 735 | 257 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 28 634 | 31 472 | 0 | (166) | (0,04) | |
| | 01/2024 | HUF | 704 | 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | MYR | 557 | 119 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 3 512 CNY | 25 236 | 53 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 2 € | 2 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 2 805 ¥ | 413 568 | 130 | 0 | 0,03 | |
| | 02/2024 | | 12 311 CNY | 87 698 | 89 | 0 | 0,02 | |
| | 03/2024 | | 1 544 CNH | 11 133 | 29 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | | 3 094 IDR | 47 687 837 | 4 | (6) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 214 ILS | 772 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 06/2024 | KRW | 1 103 551 \$ | 848 | 0 | (11) | 0,00 | |
| | 10/2024 | ¥ | 600 000 | 4 906 | 480 | 0 | 0,11 | |
| RBC | 03/2024 | \$ | 213 IDR | 3 292 435 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 12 MXN | 216 | 0 | 0 | 0,00 | |
| RYL | 01/2024 | AUD | 707 \$ | 475 | 0 | (7) | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | MYR | 204 | 44 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 3 618 CNY | 25 996 | 55 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 2 817 SEK | 29 255 | 87 | 0 | 0,02 | |
| | 02/2024 | CNY | 25 887 \$ | 3 608 | 0 | (52) | (0,01) | |
| | 02/2024 | \$ | 21 CNY | 151 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 788 880 \$ | 50 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 46 401 | 1 495 | 0 | (42) | (0,01) | |
| | 03/2024 | \$ | 1 407 CNH | 10 187 | 32 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | | 1 072 HKD | 8 353 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 292 IDR | 4 500 602 | 2 | (2) | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 158 INR | 13 251 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 557 THB | 53 823 | 30 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | | 920 TWD | 28 601 | 28 | 0 | 0,01 | |
| | 06/2024 | KRW | 915 660 \$ | 705 | 0 | (7) | 0,00 | |
| SOG | 02/2024 | \$ | 812 RON | 3 722 | 14 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 5 202 \$ | 165 | 0 | (7) | 0,00 | |
| SSB | 01/2024 | CLP | 214 482 | 243 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 439 £ | 349 | 6 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 299 INR | 24 955 | 0 | 0 | 0,00 | |
| TOR | 01/2024 | | 4 637 ¥ | 680 116 | 191 | 0 | 0,04 | |
| | 02/2024 | ¥ | 1 720 000 \$ | 11 624 | 0 | (635) | (0,15) | |
| | 03/2024 | IDR | 780 507 | 49 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 682 CNH | 4 927 | 13 | 0 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | £ | 7 618 \$ | 9 641 | 0 | (71) | (0,02) | |
| | 01/2024 | HUF | 6 200 | 17 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 209 BRL | 1 033 | 4 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 173 HUF | 63 543 | 10 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 100 MXN | 1 769 | 4 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 2 483 NOK | 26 491 | 126 | 0 | 0,03 | |
| | 01/2024 | | 317 SEK | 3 180 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 029 ZAR | 19 639 | 44 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | | 762 CZK | 16 964 | 0 | (5) | 0,00 | |
| | | | | | \$ 3 854 | \$ (1 832) | \$ 2 022 | 0,47 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (partiellement couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 1 630 | \$ 1 079 | \$ 0 | \$ (33) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | | 865 | 572 | 0 | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 254 | 322 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 517 889 | 3 509 | 0 | (166) | (0,04) |
| | 01/2024 | NOK | 1 165 | 110 | 0 | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD | 652 | 397 | 0 | (16) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | DKK | 1 531 | 226 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 923 | 1 013 | 1 | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 507 | 643 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 368 245 | 2 510 | 0 | (104) | (0,02) |
| BRC | 01/2024 | \$ | 2 844 | CHF 2 481 | 105 | 105 | 0,02 |
| CBK | 01/2024 | NOK | 282 | \$ 26 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK | 26 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 4 492 | CHF 3 914 | 160 | 160 | 0,04 |
| | 01/2024 | | 0 | DKK 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 191 | € 173 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 0 | NOK 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD | 3 527 | \$ 2 595 | 0 | (80) | (0,02) |
| MBC | 01/2024 | \$ | 40 629 | CHF 35 605 | 1 696 | 1 696 | 0,39 |
| | 01/2024 | AUD | 986 | \$ 654 | 0 | (19) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | CAD 281 | \$ 207 | \$ 0 | \$ (5) | \$ (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 21 904 | 24 083 | 0 | (119) | (119) | (0,03) |
| MYI | 01/2024 | £ 148 | 188 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 196 728 | 1 334 | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 39 511 | CHF 34 490 | 1 490 | 0 | 1 490 | 0,34 |
| SCX | 01/2024 | SEK 8 947 | \$ 861 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| UAG | 01/2024 | DKK 2 031 | 298 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 2 754 | 3 485 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| | 01/2024 | NOK 6 483 | 608 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | | | | \$ 3 452 | \$ (729) | \$ 2 723 | 0,63 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD 2 977 | \$ 1 972 | \$ 0 | \$ (60) | \$ (60) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | £ 249 | 316 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 977 859 | 6 626 | 0 | (314) | (314) | (0,07) |
| | 01/2024 | NOK 2 138 | 201 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD 817 | 497 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| BPS | 01/2024 | DKK 2 850 | 420 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 14 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 949 | 1 204 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 626 927 | 4 274 | 0 | (175) | (175) | (0,04) |
| | 01/2024 | \$ 2 131 | € 1 954 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 0 | CHF 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € 6 | \$ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK 517 | 48 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK 48 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 0 | DKK 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 11 | € 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | NOK 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD 6 655 | \$ 4 897 | 0 | (151) | (151) | (0,04) |
| | 01/2024 | CHF 1 952 | 2 227 | 0 | (93) | (93) | (0,02) |
| MBC | 01/2024 | DKK 3 776 | 557 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD 2 328 | 1 543 | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| | 01/2024 | CAD 378 | 279 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 20 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 16 937 | 119 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | \$ 1 012 | € 922 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 371 455 | \$ 2 520 | 0 | (117) | (117) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 75 622 | € 68 802 | 398 | 0 | 398 | 0,09 |
| SCX | 01/2024 | SEK 16 648 | \$ 1 603 | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| UAG | 01/2024 | AUD 1 129 | 749 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 5 158 | 6 528 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 01/2024 | NOK 11 895 | 1 115 | 0 | (56) | (56) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 39 650 | € 36 047 | 178 | 0 | 178 | 0,04 |
| | | | | \$ 609 | \$ (1 184) | \$ (575) | (0,13) |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (partiellement couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD 782 | \$ 518 | \$ 0 | \$ (16) | \$ (16) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 782 | 517 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 136 | 172 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 237 879 | 1 612 | 0 | (76) | (76) | (0,02) |
| | 01/2024 | NZD 253 | 154 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | \$ 13 953 | NOK 148 353 | 657 | 0 | 657 | 0,15 |
| | 01/2024 | AUD 95 | \$ 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK 756 | 112 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 396 | 432 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 233 | 296 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 175 550 | 1 196 | 0 | (50) | (50) | (0,01) |
| BRC | 01/2024 | DKK 1 004 | 147 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 0 | CHF 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € 190 | \$ 209 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 72 | 91 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK 12 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 0 | DKK 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 6 550 | NOK 70 101 | 354 | 0 | 354 | 0,08 |
| GLM | 01/2024 | CAD 1 750 | \$ 1 290 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| | 01/2024 | CHF 492 | 561 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 7 | NOK 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | CAD 111 | \$ 84 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 132 | 98 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 10 310 | 11 336 | 0 | (56) | (56) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ 16 187 | 114 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 230 | NOK 2 506 | \$ 17 | \$ 0 | \$ 17 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | ¥ 90 362 | \$ 613 | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| SCX | 01/2024 | SEK 4 137 | 398 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 1 266 | 1 603 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 20 502 | NOK 218 539 | 1 021 | 0 | 1 021 | 0,23 |
| | | | | \$ 2 049 | \$ (349) | \$ 1 700 | 0,39 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ 5 567 | 1,29 |

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 2,000 % éch. 01/01/2039 | \$ 7 000 | \$ (6 277) | (1,45) |
| 2,000 % éch. 01/01/2054 | 27 750 | (22 685) | (5,25) |
| 3,000 % éch. 01/03/2054 | 2 500 | (2 217) | (0,52) |
| 5,500 % éch. 01/01/2054 | 10 900 | (10 948) | (2,53) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (42 127) | (9,75) |
| Total des Investissements | | \$ 542 404 | 125,47 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (110 114) | (25,47) |
| Actifs nets | | \$ 432 290 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

- * Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (c) Titre à coupon zéro.
- (d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (g) Affilié au Fonds.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,46 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG 3,035 % éch. 28/05/2032 | 21/06/2021 | \$ 1 061 | \$ 878 | 0,20 |
| DrillCo Holding Lux S.A. | 08/06/2023 | 321 | 399 | 0,09 |
| | | \$ 1 382 | \$ 1 277 | 0,29 |

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 1 525 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 14 326 \$ (31 décembre 2022 : 13 884 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 870 \$ (31 décembre 2022 : 1 120 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | | Autres données significatives observables (Niveau 2) | | Données significatives non observables (Niveau 3) | | Juste valeur |
|---|---|--|--|--|---|--|-------------------|
| | | | | | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 0 | | \$ 556 360 | | \$ 1 793 | | \$ 558 153 |
| Fonds d'investissement | 18 210 | | 0 | | 0 | | 18 210 |
| Contrats de mise en pension | 0 | | 534 | | 0 | | 534 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (3 319) | | 10 953 | | 0 | | 7 634 |
| Titres vendus à découvert | 0 | | (42 127) | | 0 | | (42 127) |
| Totaux | \$ 14 891 | | \$ 525 720 | | \$ 1 793 | | \$ 542 404 |

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 442 801 | \$ 831 | \$ 443 632 |
| Fonds d'investissement | 18 242 | 0 | 0 | 18 242 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 408 | 0 | 1 408 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 4 652 | (41) | 0 | 4 611 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (28 813) | 0 | (28 813) |
| Totaux | \$ 22 894 | \$ 415 355 | \$ 831 | \$ 439 080 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (55) | \$ 0 | \$ (55) | \$ 7 | \$ 0 | \$ 7 |
| BOA | 332 | (270) | 62 | 1 000 | (730) | 270 |
| BOM | S/O | S/O | S/O | 24 | 0 | 24 |
| BPS | (275) | 280 | 5 | (629) | 560 | (69) |
| BRC | 326 | (230) | 96 | 272 | 0 | 272 |
| BSH | S/O | S/O | S/O | 3 | 0 | 3 |
| CBK | 559 | (600) | (41) | 1 063 | (1 120) | (57) |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (8) | 0 | (8) |
| DUB | (17) | (50) | (67) | (125) | 20 | (105) |
| FAR | (5) | 0 | (5) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 1 938 | (1 980) | (42) | 150 | (370) | (220) |
| GST | 10 | 0 | 10 | 4 | 0 | 4 |
| HUS | S/O | S/O | S/O | (4) | 0 | (4) |
| IND | S/O | S/O | S/O | 110 | 0 | 110 |
| JPM | (82) | 0 | (82) | 1 248 | (760) | 488 |
| MBC | (127) | 320 | 193 | 264 | (90) | 174 |
| MYC | (42) | 0 | (42) | (5) | 0 | (5) |
| MYI | 2 281 | (2 710) | (429) | (909) | 540 | (369) |
| RBC | 1 | 0 | 1 | 116 | 0 | 116 |
| RYL | (7) | 0 | (7) | (2) | 0 | (2) |
| SCX | 41 | 0 | 41 | 992 | (910) | 82 |
| SOG | 7 | 0 | 7 | 77 | (70) | 7 |
| SSB | 3 | 0 | 3 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (432) | 270 | (162) | 6 | 0 | 6 |
| UAG | 1 111 | (1 380) | (269) | 85 | 0 | 85 |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû/de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 74,54 | 65,89 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 54,44 | 41,33 |
| Autres valeurs mobilières | 0,14 | 0,88 |
| Fonds d'investissement | 4,21 | 4,44 |
| Contrats de mise en pension | 0,12 | 0,34 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (1,16) | 1,08 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 1,64 | (0,87) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 1,29 | 0,91 |
| Titres vendus à découvert | (9,75) | (7,03) |
| Contrats de prise en pension | S/O | (0,37) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Argentine | 0,03 | 0,02 |
| Australie | 1,65 | 1,74 |
| Brésil | 0,00 | 0,76 |
| Bulgarie | 0,43 | S/O |
| Canada | 1,57 | 0,73 |
| Îles Caïmans | 3,87 | 5,78 |
| Chili | 0,29 | 0,56 |
| Chine | 0,07 | S/O |
| Colombie | 0,50 | 0,02 |
| République tchèque | 0,11 | 0,10 |
| Danemark | 2,49 | 2,67 |
| République dominicaine | 0,30 | 0,16 |
| France | 2,78 | 2,83 |
| Allemagne | 2,02 | 2,33 |
| Guatemala | 0,09 | 0,10 |
| Hong Kong | S/O | 0,21 |
| Hongrie | 1,38 | 0,03 |
| Indonésie | 1,11 | 1,10 |
| Irlande | 4,79 | 5,34 |
| Israël | 1,88 | 0,98 |
| Italie | 7,28 | 7,32 |
| Côte d'Ivoire | 0,53 | 0,35 |
| Japon | 6,33 | 4,40 |
| Kazakhstan | 0,43 | S/O |
| Luxembourg | 1,24 | 0,67 |
| Malaisie | 0,46 | 0,98 |
| Mexique | S/O | 0,28 |
| Maroc | S/O | 0,37 |
| Multinationales | 0,21 | 0,25 |
| Pays-Bas | 1,28 | 1,59 |
| Nouvelle-Zélande | 0,07 | 0,07 |
| Norvège | 0,19 | 0,20 |
| Pérou | 0,50 | 1,68 |
| Philippines | 0,08 | 0,08 |
| Pologne | 0,78 | 0,03 |
| Portugal | 0,18 | 0,09 |
| Qatar | 0,07 | 0,08 |
| Roumanie | 1,07 | 0,63 |
| Russie | 0,08 | 0,20 |
| Arabie saoudite | 0,83 | S/O |
| Serbie | 0,82 | 0,88 |
| Singapour | 0,42 | 0,20 |
| Slovénie | 0,19 | 0,18 |
| Afrique du Sud | 0,09 | 0,09 |
| Corée du Sud | 2,67 | 0,78 |
| Espagne | 0,87 | 1,04 |
| Supranationales | 0,67 | 0,71 |
| Suisse | 1,10 | 1,64 |
| Thaïlande | 0,22 | 0,26 |
| Émirats arabes unis | 0,46 | 0,05 |
| Royaume-Uni | 8,07 | 9,05 |
| États-Unis | 62,17 | 45,54 |
| Instruments à court terme | 4,40 | 2,95 |
| Fonds d'investissement | 4,21 | 4,44 |
| Contrats de mise en pension | 0,12 | 0,34 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (1,16) | 1,09 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,18) | (0,15) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,09 | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base | S/O | 0,01 |
| Swaps de taux d'intérêt | 1,73 | (0,73) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,05 | 0,05 |
| Options sur titres | 0,08 | 0,08 |
| Options vendues | | |
| Options de change | (0,02) | S/O |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,19) | (0,27) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,01) | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,01 |
| Swaps sur devises croisées | 0,01 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | 0,00 |
| Contrats de change à terme | 0,47 | 0,37 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,89 | 0,68 |
| Titres vendus à découvert | (9,75) | (7,03) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (25,47) | (6,97) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | | | | | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|--------------------------------------|---|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|---|---|---|-------------------------|----------|-----------|--------|---------|-------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| AUSTRALIE | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| RESIMAC Bastille Trust 6,390 % éch. 05/09/2057 | \$ 631 | \$ 631 | 0,00 | OZLM Ltd. 6,682 % éch. 16/05/2030 | \$ 5 206 | \$ 5 200 | 0,04 | 1,000 % éch. 01/10/2053 DKK | 34 560 | \$ 3 967 | 0,03 | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement australien 0,500 % éch. 21/09/2026 | AUD 146 900 | 92 252 | 0,71 | 6,827 % éch. 20/01/2031 | 3 129 | 3 133 | 0,02 | 2,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 1,000 % éch. 21/12/2030 | 14 400 | 8 155 | 0,06 | Palmer Square CLO Ltd. 6,794 % éch. 17/01/2031 | 2 466 | 2 470 | 0,02 | 2,500 % éch. 01/04/2036 | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 1,250 % éch. 21/05/2032 | 13 600 | 7 538 | 0,06 | Regatta Funding Ltd. 6,914 % éch. 17/10/2030 | 6 595 | 6 593 | 0,05 | 2,500 % éch. 01/04/2047 | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 1,750 % éch. 21/06/2051 | 16 900 | 6 818 | 0,05 | Sound Point CLO Ltd. 6,741 % éch. 26/07/2031 | 1 191 | 1 190 | 0,01 | 3,000 % éch. 01/07/2046 | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 2,500 % éch. 21/05/2030 | 17 800 | 11 288 | 0,09 | Venture CLO Ltd. 6,535 % éch. 15/04/2027 | 837 | 837 | 0,01 | 4,820 % éch. 01/01/2038 | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | | |
| 4,500 % éch. 21/04/2033 | 108 700 | 77 379 | 0,59 | | | | | Total Danemark | | | 264 682 | 2,02 | | | | | | | | |
| | | | 203 430 | 1,56 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | | | | | |
| Total Australie | | | | 204 061 | 1,56 | Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027 | 431 | 382 | 0,00 | FINLANDE | | | | | | | | | | |
| CANADA | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % éch. 29/03/2028 | € 12 300 | 12 989 | 0,10 | Gaci First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030 | 23 000 | 23 029 | 0,18 | BNP Paribas S.A. 2,219 % éch. 09/06/2026 | | | | \$ 5 200 | 4 967 | 0,04 | | | | | | |
| Royal Bank of Canada 4,851 % éch. 14/12/2026 | \$ 20 400 | 20 563 | 0,15 | 4,875 % éch. 14/02/2035 | 22 100 | 21 633 | 0,17 | Dexia Credit Local S.A. 0,000 % éch. 21/01/2028 (c) | | | | € 9 100 | 9 079 | 0,07 | | | | | | |
| | | | 33 552 | 0,25 | 5,125 % éch. 14/02/2053 | 14 400 | 13 077 | 0,10 | 0,500 % éch. 17/01/2025 | | | | 2 300 | 2 469 | 0,02 | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | | | | | | FRANCE | | | | | | | | |
| Real Estate Asset Liquidity Trust 3,650 % éch. 12/08/2053 | CAD 5 218 | 3 799 | 0,03 | KSA Sukuk Ltd. 5,268 % éch. 25/10/2028 | 8 500 | 8 839 | 0,07 | Société Générale S.A. 1,488 % éch. 14/12/2026 | | | | \$ 21 700 | 19 989 | 0,15 | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/06/2028 | 650 | 470 | 0,00 | QNB Finance Ltd. 1,375 % éch. 26/01/2026 | 2 060 | 1 906 | 0,01 | 2,226 % éch. 21/01/2026 | | | | 24 200 | 23 255 | 0,18 | | | | | | |
| 2,750 % éch. 01/12/2033 | 115 680 | 88 872 | 0,68 | Sands China Ltd. 5,375 % éch. 08/08/2025 | 4 100 | 4 046 | 0,03 | 2,797 % éch. 19/01/2028 | | | | 17 500 | 16 131 | 0,12 | | | | | | |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/12/2044 (e) | | | | 10 701 | 8 035 | 0,06 | 5,650 % éch. 08/08/2028 | 9 300 | 9 228 | 0,07 | 6,446 % éch. 10/01/2029 | | | | 3 100 | 3 209 | 0,02 | | | |
| CPPIB Capital, Inc. 0,750 % éch. 02/02/2037 | € 2 200 | 1 829 | 0,02 | Suci Second Investment Co. 6,000 % éch. 25/10/2028 | 29 600 | 31 319 | 0,24 | 6,691 % éch. 10/01/2034 | | | | 25 400 | 26 850 | 0,21 | | | | | | |
| Ontario Teachers' Finance Trust 0,900 % éch. 20/05/2041 | 9 700 | 7 405 | 0,06 | | | | 113 459 | 0,87 | | | | | 105 949 | 0,81 | | | | | | |
| Province de l'Ontario 0,010 % éch. 25/11/2030 | 30 200 | 27 694 | 0,21 | Total Îles Caïmans | | | | 255 179 | 1,95 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | | | |
| | | | 134 305 | 1,03 | CHINE | | | | | | | | Obligation internationale du gouvernement français | | | | | | | |
| Total Canada | | | | 171 656 | 1,31 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | 0,500 % éch. 25/06/2044 | | | | € 6 750 | 4 673 | 0,04 |
| ILES CAÏMANS | | | | | | | | | | | | 0,500 % éch. 25/05/2072 | | | | 15 250 | 7 069 | 0,05 | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | | | | | | | | | 0,750 % éch. 25/05/2052 | | | | 115 450 | 73 154 | 0,56 | | |
| Apidos CLO 6,735 % éch. 15/04/2031 | \$ 4 387 | 4 386 | 0,03 | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | | | | | | 2,000 % éch. 25/05/2048 | | | | 73 081 | 66 798 | 0,51 | | |
| 6,847 % éch. 20/10/2031 | 12 240 | 12 253 | 0,09 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | 3,250 % éch. 25/05/2045 | | | | 19 100 | 22 022 | 0,17 | | |
| Atlas Senior Loan Fund Ltd. 6,805 % éch. 16/01/2030 | 5 423 | 5 416 | 0,04 | Obligation internationale du gouvernement de République tchèque | | | | | | | | | | | | 173 716 | | | | 1,33 |
| Benefit Street Partners CLO Ltd. 6,767 % éch. 20/04/2031 | 8 067 | 8 053 | 0,06 | 2,500 % éch. 25/08/2028 | | | | CZK 2 900 | 123 | 0,00 | Total France | | | | 279 665 | | | | 2,14 | |
| BlueMountain CLO Ltd. 6,735 % éch. 15/07/2031 | 8 171 | 8 164 | 0,06 | DANEMARK | | | | | | | | ALLEMAGNE | | | | | | | | |
| Carbone CLO Ltd. 6,817 % éch. 20/01/2031 | 6 075 | 6 079 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | |
| Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,691 % éch. 15/05/2031 | 5 527 | 5 522 | 0,04 | Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | | | | DKK 502 190 | 56 181 | 0,43 | Aareal Bank AG 0,625 % éch. 14/02/2025 | | | | \$ 800 | 761 | 0,01 | | | |
| 6,755 % éch. 15/10/2030 | 2 349 | 2 350 | 0,02 | 1,500 % éch. 01/10/2037 | | | | 0 | 0 | 0,00 | Deutsche Bank AG 0,050 % éch. 20/11/2024 | | | | € 19 600 | 20 987 | 0,16 | | | |
| Catamaran CLO Ltd. 6,774 % éch. 22/04/2030 | 17 486 | 17 484 | 0,13 | 1,500 % éch. 01/07/2050 | | | | 0 | 0 | 0,00 | 1,375 % éch. 03/09/2026 | | | | 32 100 | 33 985 | 0,26 | | | |
| CBAM Ltd. 6,927 % éch. 20/07/2030 | 14 043 | 14 044 | 0,11 | 1,500 % éch. 01/10/2050 | | | | 0 | 0 | 0,00 | 1,375 % éch. 17/02/2032 | | | | 14 300 | 13 004 | 0,10 | | | |
| Deer Creek CLO Ltd. 6,857 % éch. 20/10/2030 | 3 270 | 3 268 | 0,03 | 2,000 % éch. 01/10/2053 | | | | 0 | 0 | 0,00 | 1,625 % éch. 20/01/2027 | | | | 8 100 | 8 414 | 0,07 | | | |
| Dryden Senior Loan Fund 6,625 % éch. 15/04/2031 | 9 771 | 9 760 | 0,07 | 2,000 % éch. 01/10/2047 | | | | 0 | 0 | 0,00 | 1,750 % éch. 19/11/2030 | | | | 20 500 | 19 716 | 0,15 | | | |
| ICG U.S. CLO Ltd. 6,754 % éch. 22/07/2031 | 12 705 | 12 709 | 0,10 | 2,000 % éch. 01/10/2050 | | | | 0 | 0 | 0,00 | 1,875 % éch. 23/02/2028 | | | | 5 900 | 6 132 | 0,05 | | | |
| Marble Point CLO Ltd. 6,837 % éch. 18/12/2030 | 12 806 | 12 809 | 0,10 | 2,500 % éch. 01/10/2037 | | | | 0 | 0 | 0,00 | 2,625 % éch. 16/12/2024 | | | | € 23 600 | 29 172 | 0,22 | | | |
| | | | | 2,500 % éch. 01/10/2047 | | | | 0 | 0 | 0,00 | 3,729 % éch. 14/01/2032 (h) | | | | \$ 2 000 | 1 677 | 0,01 | | | |
| | | | | 3,000 % éch. 01/10/2047 | | | | 0 | 0 | 0,00 | 3,961 % éch. 26/11/2025 | | | | 26 750 | 26 317 | 0,20 | | | |
| | | | | 5,000 % éch. 01/10/2053 | | | | 248 816 | 37 000 | 0,28 | 4,100 % éch. 13/01/2026 | | | | 1 800 | 1 751 | 0,01 | | | |
| | | | | Realcredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | | | | 115 699 | 13 421 | 0,10 | IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature) 3,750 % éch. 15/09/2026 (b) | | | | € 12 050 | 13 161 | 0,10 | | | |
| | | | | | | | | | | | | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5,000 % éch. 19/03/2024 AUD | | | | 1 500 | 1 025 | 0,01 | | |
| | | | | | | | | | | | | Total Allemagne | | | | 176 102 | | | | 1,35 |
| | | | | | | | | | | | | HONGRIE | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | Obligation internationale du gouvernement hongrois 3,000 % éch. 27/10/2027 HUF | | | | 117 500 | 309 | 0,00 | | |
| | | | | | | | | | | | | 5,000 % éch. 22/02/2027 | | | | € 4 100 | 4 733 | 0,04 | | |
| | | | | | | | | | | | | 6,250 % éch. 22/09/2032 | | | | \$ 17 200 | 18 396 | 0,14 | | |
| | | | | | | | | | | | | 7,625 % éch. 29/03/2041 | | | | 100 | 120 | 0,00 | | |
| | | | | | | | | | | | | Total Hongrie | | | | 23 558 | | | | 0,18 |
| | | | | | | | | | | | | INTERNATIONALES | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | Project Mercury 8,127 % éch. 11/08/2030 | | | | € 25 000 | 27 703 | 0,21 | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| IRLANDE | | | | IRLANDE | | | | IRLANDE | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | JAPAN FINANCE ORGANIZATION FOR MUNICIPALITIES | | | |
| Accunia European CLO DAC | | | | AerCap Ireland Capital DAC | | | | 0,625 % éch. 02/09/2025 | \$ 1 400 | \$ 1 305 | 0,01 |
| 4,915 % éch. 15/07/2030 | € 4 290 | \$ 4 735 | 0,04 | 1,650 % éch. 29/10/2024 | \$ 5 450 | 5 263 | 0,04 | 3,000 % éch. 12/03/2024 | 13 100 | 13 037 | 0,10 |
| Adagio CLO DAC | | | | 1,750 % éch. 29/10/2024 | 5 300 | 5 121 | 0,03 | Obligation internationale du gouvernement japonais | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | 10 250 | 11 169 | 0,08 | 2,450 % éch. 29/10/2026 | 200 | 185 | 0,00 | 0,005 % éch. 01/02/2024 | ¥ 700 000 | 4 966 | 0,04 |
| Aqueduct European CLO DAC | | | | 3,000 % éch. 29/10/2028 | 900 | 822 | 0,01 | 0,005 % éch. 01/03/2024 | 15 550 000 | 110 326 | 0,84 |
| 4,633 % éch. 20/07/2030 | 9 527 | 10 447 | 0,08 | 3,500 % éch. 15/01/2025 | 1 300 | 1 271 | 0,01 | 0,005 % éch. 01/04/2024 | 8 140 000 | 57 762 | 0,44 |
| Ares European CLO DAC | | | | | | | | 0,005 % éch. 01/05/2024 | 5 580 000 | 39 600 | 0,30 |
| 4,575 % éch. 15/04/2030 | 6 807 | 7 460 | 0,06 | | | | | 0,005 % éch. 01/10/2024 | 17 912 450 | 127 122 | 0,97 |
| 4,625 % éch. 15/10/2030 | 14 907 | 16 347 | 0,12 | | | | | 0,100 % éch. | | | |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | 23 787 | 26 029 | 0,20 | | | | | 10/03/2028 (e) | 14 755 458 | 110 001 | 0,84 |
| 4,843 % éch. 20/04/2032 | 9 100 | 9 894 | 0,08 | | | | | 0,200 % éch. 20/06/2036 | 362 750 | 2 369 | 0,02 |
| Armada Euro CLO DAC | | | | | | | | 0,500 % éch. 20/09/2046 | 8 768 000 | 50 253 | 0,39 |
| 4,685 % éch. 15/07/2031 | 8 952 | 9 784 | 0,07 | | | | | 0,500 % éch. 20/03/2049 | 11 468 000 | 63 119 | 0,48 |
| Aurium CLO DAC | | | | | | | | 0,700 % éch. 20/12/2048 | 7 461 650 | 43 424 | 0,33 |
| 4,695 % éch. 16/01/2031 | 28 733 | 31 397 | 0,24 | | | | | 0,700 % éch. 20/06/2051 | 202 000 | 1 139 | 0,01 |
| Avoca CLO DAC | | | | | | | | 1,000 % éch. 20/03/2052 | 70 000 | 425 | 0,00 |
| 4,785 % éch. 15/10/2032 | 9 800 | 10 692 | 0,08 | | | | | 1,300 % éch. 20/06/2052 | 500 000 | 3 268 | 0,03 |
| Bain Capital Euro CLO DAC | | | | | | | | 1,500 % éch. 20/09/2043 | 11 670 000 | 84 317 | 0,65 |
| 4,733 % éch. 20/01/2032 | 12 296 | 13 417 | 0,10 | | | | | Gouvernement de la métropole de Tokyo | | | |
| Black Diamond CLO DAC | | | | | | | | 0,750 % éch. 16/07/2025 | \$ 18 600 | 17 458 | 0,13 |
| 4,982 % éch. 15/05/2032 | 5 276 | 5 755 | 0,04 | Total Irlande | | 650 247 | 4,97 | | | | |
| Blackrock European CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,585 % éch. 15/10/2031 | 10 606 | 11 533 | 0,09 | | | | | | | | |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,685 % éch. 15/01/2031 | 11 174 | 12 209 | 0,09 | | | | | | | | |
| BNPP AM Euro CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,822 % éch. 22/07/2032 | 12 700 | 13 847 | 0,11 | | | | | | | | |
| Cairn CLO BV | | | | | | | | | | | |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | 16 389 | 17 808 | 0,14 | | | | | | | | |
| Carlyle Euro CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,632 % éch. 15/08/2030 | 5 648 | 6 183 | 0,05 | | | | | | | | |
| 4,892 % éch. 15/08/2032 | 3 200 | 3 488 | 0,03 | | | | | | | | |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | | | | | | | | | |
| 4,752 % éch. 15/11/2031 | 11 479 | 12 505 | 0,10 | | | | | | | | |
| Contego CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,642 % éch. 23/01/2030 | 6 279 | 6 837 | 0,05 | | | | | | | | |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,652 % éch. 21/07/2030 | 20 067 | 21 917 | 0,17 | | | | | | | | |
| Dryden Euro CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,625 % éch. 15/04/2033 | 6 566 | 7 148 | 0,05 | | | | | | | | |
| 4,862 % éch. 15/05/2034 | 23 408 | 25 466 | 0,19 | | | | | | | | |
| Griffith Park CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,704 % éch. 21/11/2031 | 14 240 | 15 481 | 0,12 | | | | | | | | |
| Harvest CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,566 % éch. 26/06/2030 | 6 583 | 7 193 | 0,05 | | | | | | | | |
| 4,673 % éch. 20/10/2031 | 15 251 | 16 598 | 0,13 | | | | | | | | |
| 4,725 % éch. 15/07/2031 | 9 850 | 10 725 | 0,08 | | | | | | | | |
| 4,815 % éch. 15/01/2032 | 22 300 | 24 320 | 0,19 | | | | | | | | |
| Jubilee CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,565 % éch. 15/04/2030 | 19 072 | 20 881 | 0,16 | | | | | | | | |
| 4,615 % éch. 15/04/2031 | 1 100 | 1 197 | 0,01 | | | | | | | | |
| Laurelin DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,713 % éch. 20/10/2031 | 14 251 | 15 588 | 0,12 | | | | | | | | |
| Madison Park Euro Funding DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,715 % éch. 15/01/2032 | 22 900 | 24 928 | 0,19 | | | | | | | | |
| 4,765 % éch. 15/07/2032 | 7 300 | 7 955 | 0,06 | | | | | | | | |
| Man GLG Euro CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,775 % éch. 15/10/2032 | 9 835 | 10 732 | 0,08 | | | | | | | | |
| Oak Hill European Credit Partners DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,733 % éch. 20/10/2031 | 24 038 | 26 261 | 0,20 | | | | | | | | |
| OCP Euro CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,882 % éch. 22/09/2034 | 22 300 | 24 283 | 0,19 | | | | | | | | |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | 11 036 | 11 997 | 0,09 | | | | | | | | |
| 4,695 % éch. 15/07/2031 | 3 157 | 3 445 | 0,03 | | | | | | | | |
| 4,745 % éch. 15/04/2031 | 14 471 | 15 763 | 0,12 | | | | | | | | |
| Sculptor European CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,755 % éch. 14/01/2032 | 35 800 | 38 981 | 0,30 | | | | | | | | |
| Segovia European CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,873 % éch. 20/07/2032 | 13 700 | 14 942 | 0,11 | | | | | | | | |
| Tikehau CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,844 % éch. 04/08/2034 | 10 600 | 11 574 | 0,09 | | | | | | | | |
| Toro European CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,812 % éch. 15/02/2034 | 22 750 | 24 789 | 0,19 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| MULTINATIONALES | | | | PORTUGAL | | | | ESPAGNE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Preferred Term Securities Ltd. 5,956 % éch. 22/12/2036 | \$ 8 587 | \$ 8 115 | 0,06 | Banco Espirito Santo S.A. 4,000 % éch. 21/01/2019 ^ | € 6 900 | \$ 2 096 | 0,02 | 2,125 % éch. 10/06/2027 KRW | 16 365 000 | \$ 12 273 | 0,09 |
| 6,046 % éch. 22/03/2038 | 2 913 | 2 621 | 0,02 | 4,750 % éch. 15/01/2018 ^ | 1 900 | 577 | 0,00 | 2,375 % éch. 10/12/2027 | 14 900 000 | 11 233 | 0,08 |
| Total Multinationales | | 10 736 | 0,08 | Total Portugal | | 2 673 | 0,02 | 2,375 % éch. 10/12/2028 | 113 474 130 | 85 023 | 0,65 |
| PAYS-BAS | | | | QATAR | | | | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| ABN AMRO Bank NV 1,125 % éch. 12/01/2032 | € 300 | 293 | 0,00 | QatarEnergy 2,250 % éch. 12/07/2031 | \$ 8 000 | 6 821 | 0,05 | BBVA Consumer Auto 0,270 % éch. 20/07/2031 | € 2 917 | 3 153 | 0,02 |
| Cooperatieve Rabobank UA 3,758 % éch. 06/04/2033 | \$ 2 300 | 2 066 | 0,02 | 3,300 % éch. 12/07/2051 | 5 100 | 3 736 | 0,03 | Total Corée du Sud | | 433 976 | 3,32 |
| CTP NV 0,625 % éch. 27/09/2026 | € 10 500 | 10 444 | 0,08 | Total Qatar | | 10 557 | 0,08 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 0,875 % éch. 20/01/2026 | 14 100 | 14 453 | 0,11 | ROUMANIE | | | | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES | | | |
| 1,500 % éch. 27/09/2031 | 6 500 | 5 608 | 0,04 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Sagax Euro MTN NL BV 1,625 % éch. 24/02/2026 | 11 900 | 12 476 | 0,10 | Obligation internationale du gouvernement roumain 1,375 % éch. 02/12/2029 | € 6 560 | 5 987 | 0,04 | Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario 4,125 % éch. 18/01/2049 | € 328 | 359 | 0,00 |
| | | 45 340 | 0,35 | 1,750 % éch. 13/07/2030 | 16 600 | 14 872 | 0,11 | Fondo de Titulizacion de Activos UCI 4,065 % éch. 15/09/2041 | 648 | 703 | 0,01 |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES | | | | ARABIE SAOUDITE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Domi BV 4,775 % éch. 15/06/2051 | 90 | 100 | 0,00 | Saudi Arabian Oil Co. 2,250 % éch. 24/11/2030 | \$ 12 600 | 10 851 | 0,08 | Communauté autonome de Catalogne 4,220 % éch. 26/04/2035 | 3 900 | 4 426 | 0,03 |
| Dutch Property Finance BV 4,602 % éch. 28/07/2054 | 197 | 218 | 0,00 | 3,250 % éch. 24/11/2050 | 6 500 | 4 629 | 0,04 | Communauté autonome de Madrid 1,571 % éch. 30/04/2029 | 1 300 | 1 349 | 0,01 |
| 4,602 % éch. 28/07/2058 | 13 146 | 14 487 | 0,11 | 3,500 % éch. 24/11/2070 | 1 600 | 1 104 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,450 % éch. 31/10/2071 | 7 375 | 4 117 | 0,03 |
| Eurosaill BV 5,485 % éch. 17/10/2040 | 8 | 9 | 0,00 | Total Arabie saoudite | | 16 584 | 0,13 | 1,900 % éch. 31/10/2052 | 2 700 | 2 065 | 0,02 |
| Jubilee Place BV 4,815 % éch. 17/07/2058 | 9 711 | 10 742 | 0,08 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 4,985 % éch. 17/10/2057 | 5 226 | 5 791 | 0,05 | Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 3,250 % éch. 22/10/2030 | 3 100 | 2 880 | 0,02 | 3,450 % éch. 30/07/2066 | 53 300 | 55 207 | 0,42 |
| | | 31 347 | 0,24 | 4,750 % éch. 18/01/2028 | 32 400 | 32 774 | 0,25 | 5,250 % éch. 06/04/2029 | € 800 | 1 073 | 0,01 |
| Total Pays-Bas | | 76 687 | 0,59 | 4,875 % éch. 18/07/2033 | 33 500 | 34 259 | 0,26 | | | 68 237 | 0,52 |
| NOUVELLE-ZÉLANDE | | | | SINGAPOUR | | | | SUPRANATIONALES | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Auckland Council 1,000 % éch. 19/01/2027 | 5 800 | 6 097 | 0,04 | Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,250 % éch. 01/08/2036 SGD | 16 910 | 12 186 | 0,10 | Banque européenne d'investissement 4,600 % éch. 30/01/2037 CAD | 1 050 | 839 | 0,01 |
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais 1,500 % éch. 15/05/2031 NZD | 22 600 | 11 833 | 0,09 | 3,375 % éch. 01/09/2033 | 6 740 | 5 408 | 0,04 | Banque interaméricaine de développement 2,500 % éch. 14/04/2027 AUD | 15 200 | 9 856 | 0,07 |
| 2,000 % éch. 20/09/2025 | 1 313 | 828 | 0,01 | Total Singapour | | 17 594 | 0,14 | Total Supranationales | | 10 695 | 0,08 |
| Total Nouvelle-Zélande | | 18 758 | 0,14 | SLOVÉNIE | | | | SUÈDE | | | |
| NORVÈGE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Kommunalbanken A/S 0,625 % éch. 20/04/2026 | € 600 | 632 | 0,00 | Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % éch. 27/01/2025 | € 11 200 | 12 317 | 0,09 | Molnlycke Holding AB 1,875 % éch. 28/02/2025 | € 400 | 432 | 0,00 |
| 1,900 % éch. 19/01/2027 AUD | 22 000 | 14 001 | 0,11 | Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % éch. 05/02/2030 (i) | 3 500 | 3 356 | 0,03 | | | | |
| 5,250 % éch. 15/07/2024 | 3 300 | 2 259 | 0,02 | 3,650 % éch. 19/11/2029 | 8 300 | 8 072 | 0,06 | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement norvégien 1,250 % éch. 17/09/2031 NOK | 1 900 | 162 | 0,00 | Total Slovénie | | 23 745 | 0,18 | | | | |
| 1,750 % éch. 13/03/2025 | 86 700 | 8 330 | 0,06 | CORÉE DU SUD | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 1,750 % éch. 17/02/2027 | 1 100 | 103 | 0,00 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 2,000 % éch. 26/04/2028 | 7 300 | 684 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 1,375 % éch. 10/12/2029 KRW | 16 465 950 | 11 578 | 0,09 | | | | |
| Total Norvège | | 26 171 | 0,20 | 1,500 % éch. 10/12/2030 | 14 561 570 | 10 132 | 0,08 | | | | |
| PÉROU | | | | POLOGNE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 2,780 % éch. 01/12/2060 | \$ 6 000 | 3 755 | 0,03 | Obligation internationale du gouvernement polonais 3,875 % éch. 14/02/2033 | € 15 400 | 17 740 | 0,13 | | | | |
| 3,230 % éch. 28/07/2121 | 4 200 | 2 622 | 0,02 | 4,250 % éch. 14/02/2043 | 3 400 | 3 962 | 0,03 | | | | |
| 5,940 % éch. 12/02/2029 PEN | 5 817 | 1 571 | 0,01 | 4,875 % éch. 04/10/2033 | \$ 6 400 | 6 504 | 0,05 | | | | |
| 6,150 % éch. 12/08/2032 | 40 948 | 10 814 | 0,08 | 5,500 % éch. 16/11/2027 | 2 700 | 2 807 | 0,02 | | | | |
| Total Pérou | | 18 762 | 0,14 | 5,500 % éch. 04/04/2053 | 5 800 | 6 063 | 0,05 | | | | |
| POLOGNE | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 3,875 % éch. 14/02/2033 | € 15 400 | 17 740 | 0,13 | | | | | | | | |
| 4,250 % éch. 14/02/2043 | 3 400 | 3 962 | 0,03 | | | | | | | | |
| 4,875 % éch. 04/10/2033 | \$ 6 400 | 6 504 | 0,05 | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 16/11/2027 | 2 700 | 2 807 | 0,02 | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 04/04/2053 | 5 800 | 6 063 | 0,05 | | | | | | | | |
| Total Pologne | | 37 076 | 0,28 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| SUISSE | | | | Canada Square Funding PLC | | | | ÉTATS-UNIS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,000 % éch. 17/06/2058 | | | | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Credit Suisse AG | | | | £ 14 562 | \$ 18 478 | 0,14 | | Accredited Mortgage Loan Trust | | | |
| 0,250 % éch. 05/01/2026 | € 11 800 | \$ 12 240 | 0,09 | 6,170 % éch. 17/06/2058 | 233 | 297 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/09/2036 | \$ 1 091 | 1 077 | 0,01 |
| UBS Group AG | | | | 6,470 % éch. 17/12/2057 | 4 403 | 5 633 | 0,04 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | |
| 2,193 % éch. 05/06/2026 | \$ 400 | 381 | 0,00 | Eurohome UK Mortgages PLC | | | | 5,590 % éch. 25/10/2036 | 4 | 2 | 0,00 |
| 2,875 % éch. 02/04/2032 | € 19 700 | 20 372 | 0,16 | 5,490 % éch. 15/06/2044 | 109 | 137 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/12/2036 | 5 848 | 3 189 | 0,03 |
| 3,091 % éch. 14/05/2032 | \$ 27 800 | 23 690 | 0,18 | Eurosail PLC | | | | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 2 139 | 706 | 0,01 |
| 3,869 % éch. 12/01/2029 | 12 550 | 11 842 | 0,09 | 4,165 % éch. 15/12/2044 | € 116 | 127 | 0,00 | 6,265 % éch. 25/01/2035 | 688 | 637 | 0,01 |
| 4,194 % éch. 01/04/2031 | 1 600 | 1 491 | 0,01 | 4,198 % éch. 13/03/2045 | 375 | 407 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/12/2034 | 909 | 823 | 0,01 |
| 4,488 % éch. 12/05/2026 | 1 500 | 1 478 | 0,01 | 5,489 % éch. 13/03/2045 | € 33 | 42 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/08/2035 | 3 908 | 3 789 | 0,03 |
| 4,550 % éch. 17/04/2026 | 400 | 395 | 0,00 | 6,039 % éch. 13/09/2045 | 774 | 974 | 0,01 | Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | |
| 6,373 % éch. 15/07/2026 | 900 | 911 | 0,01 | 6,289 % éch. 13/06/2045 | 41 | 51 | 0,00 | 6,220 % éch. 25/01/2036 | 600 | 580 | 0,01 |
| 6,442 % éch. 11/08/2028 | 30 600 | 31 797 | 0,24 | Great Hall Mortgages PLC | | | | 6,445 % éch. 25/07/2035 | 800 | 757 | 0,01 |
| 6,537 % éch. 12/08/2033 | 5 700 | 6 086 | 0,05 | 4,062 % éch. 18/03/2039 | € 123 | 136 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/11/2034 | 554 | 541 | 0,00 |
| 7,375 % éch. 07/09/2033 | £ 6 900 | 10 149 | 0,08 | 4,082 % éch. 18/06/2038 | 57 | 63 | 0,00 | Amortizing Residential Collateral Trust | | | |
| 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 15 900 | 20 266 | 0,16 | 5,579 % éch. 18/03/2039 | £ 4 670 | 5 728 | 0,04 | 6,170 % éch. 25/10/2031 | 24 | 23 | 0,00 |
| Total Suisse | | 141 098 | 1,08 | 5,812 % éch. 18/06/2039 | \$ 33 | 32 | 0,00 | Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust | 40 | 38 | 0,00 |
| THAÏLANDE | | | | Ludgate Funding PLC | | | | Argent Securities Trust | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 4,115 % éch. 01/01/2061 | | | | 5,770 % éch. 25/07/2036 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais | | | | € 416 | 442 | 0,00 | | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 5 890 | 5 134 | 0,04 |
| 3,390 % éch. 17/06/2037 | THB 945 547 | 29 360 | 0,23 | Mansard Mortgages PLC | | | | Asset-Backed Funding Certificates Trust | | | |
| ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | 5,989 % éch. 15/12/2049 | | | | 6,170 % éch. 25/06/2034 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,195 % éch. 01/12/2050 | | | | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | |
| MDGH GMTN RSC Ltd. | | | | € 1 493 | 1 517 | 0,01 | | 5,401 % éch. 25/06/2035 | 1 322 | 1 293 | 0,01 |
| 5,500 % éch. 28/04/2033 | \$ 7 000 | 7 435 | 0,06 | 4,205 % éch. 01/12/2050 | 395 | 415 | 0,00 | 6,085 % éch. 25/02/2036 | 2 094 | 2 048 | 0,02 |
| ROYAUME-UNI | | | | 4,525 % éch. 15/12/2050 | | | | 6,110 % éch. 25/12/2034 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,175 % éch. 15/12/2050 | | | | 6,130 % éch. 25/10/2032 | | | |
| Barclays PLC | | | | 1 816 | 1 864 | 0,02 | | 6,470 % éch. 25/11/2042 | 15 | 15 | 0,00 |
| 2,885 % éch. 31/01/2027 | € 13 900 | 15 107 | 0,12 | 5,425 % éch. 15/12/2050 | 3 170 | 3 086 | 0,02 | 6,520 % éch. 25/08/2037 | 2 058 | 1 791 | 0,01 |
| 3,125 % éch. 17/01/2024 | £ 800 | 1 019 | 0,01 | 5,509 % éch. 01/12/2050 | € 557 | 685 | 0,01 | Centex Home Equity Loan Trust | | | |
| 4,375 % éch. 12/01/2026 | \$ 2 200 | 2 171 | 0,02 | 5,510 % éch. 01/12/2050 | 465 | 569 | 0,01 | 5,930 % éch. 25/07/2032 | 15 | 14 | 0,00 |
| 6,496 % éch. 13/09/2027 | 23 600 | 24 272 | 0,19 | 5,549 % éch. 01/12/2050 | 332 | 395 | 0,00 | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,515 % éch. 26/06/2024 | AUD 4 000 | 2 744 | 0,02 | 6,340 % éch. 15/12/2050 | 2 279 | 2 798 | 0,02 | 5,530 % éch. 25/07/2045 | 59 | 40 | 0,00 |
| HAÏTI | | | | 6,590 % éch. 15/12/2050 | | | | 5,764 % éch. 25/01/2037 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,549 % éch. 01/12/2050 | | | | 5,890 % éch. 25/01/2037 | | | |
| Haleon UK Capital PLC | | | | 2 030 | 2 408 | 0,02 | | 7,250 % éch. 25/05/2036 | 1 282 | 666 | 0,01 |
| 3,125 % éch. 24/03/2025 | \$ 16 600 | 16 220 | 0,12 | Paragon Mortgages PLC | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | |
| HSBC Holdings PLC | | | | 5,861 % éch. 15/11/2038 | | | | 5,860 % éch. 25/06/2037 | | | |
| 2,848 % éch. 04/06/2031 | 9 900 | 8 521 | 0,07 | 6,270 % éch. 15/05/2045 | £ 1 828 | 2 334 | 0,02 | Countrywide Asset-Backed Certificates | | | |
| 2,999 % éch. 10/03/2026 | 1 300 | 1 261 | 0,01 | Polaris PLC | | | | 6,150 % éch. 25/12/2036 | 116 | 89 | 0,00 |
| 3,973 % éch. 22/05/2030 | 21 700 | 20 288 | 0,16 | 5,985 % éch. 23/12/2058 | 4 204 | 5 347 | 0,04 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | |
| 4,041 % éch. 13/03/2028 | 7 300 | 7 037 | 0,05 | Residential Mortgage Securities PLC | | | | 5,610 % éch. 25/06/2037 | 1 343 | 1 239 | 0,01 |
| 4,583 % éch. 19/06/2029 | 19 600 | 19 021 | 0,15 | 6,470 % éch. 20/06/2070 | 14 610 | 18 660 | 0,14 | 5,610 % éch. 25/07/2037 | 702 | 639 | 0,01 |
| 4,755 % éch. 09/06/2028 | 11 200 | 11 042 | 0,08 | Resloc UK PLC | | | | 5,610 % éch. 25/08/2037 | 506 | 503 | 0,00 |
| 5,210 % éch. 11/08/2028 | 19 400 | 19 394 | 0,15 | 5,499 % éch. 15/12/2043 | 49 | 61 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/08/2037 | 15 000 | 13 477 | 0,10 |
| John Lewis PLC | | | | 5,559 % éch. 15/12/2043 | | | | 5,690 % éch. 25/09/2037 | | | |
| 6,125 % éch. 21/01/2025 | £ 100 | 127 | 0,00 | 5,578 % éch. 15/12/2043 | \$ 124 | 120 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/06/2047 | 11 455 | 10 831 | 0,08 |
| Lloyds Banking Group PLC | | | | Ripon Mortgages PLC | | | | 5,790 % éch. 25/05/2047 | 7 634 | 5 284 | 0,04 |
| 4,650 % éch. 24/03/2026 | \$ 1 | 1 | 0,00 | 5,920 % éch. 28/08/2056 | £ 72 353 | 91 962 | 0,70 | 5,870 % éch. 25/09/2047 | 2 115 | 1 978 | 0,02 |
| Nationwide Building Society | | | | RMAC Securities PLC | | | | 5,990 % éch. 25/12/2036 | 5 251 | 4 897 | 0,04 |
| 2,972 % éch. 16/02/2028 | 8 800 | 8 191 | 0,06 | 4,200 % éch. 12/06/2044 | € 786 | 830 | 0,01 | 5,990 % éch. 25/09/2046 | 3 570 | 3 365 | 0,03 |
| StatWest Group PLC | | | | 5,489 % éch. 12/06/2044 | £ 324 | 402 | 0,00 | 6,130 % éch. 25/08/2035 | 1 599 | 1 551 | 0,01 |
| 5,076 % éch. 27/01/2030 | 19 200 | 18 922 | 0,14 | 5,509 % éch. 12/06/2044 | 222 | 273 | 0,00 | 6,160 % éch. 25/05/2036 | 1 681 | 1 661 | 0,01 |
| NatWest Markets PLC | | | | Southern Pacific Financing PLC | | | | 6,310 % éch. 25/10/2047 | 2 501 | 2 393 | 0,02 |
| 0,125 % éch. 12/11/2025 | € 7 721 | 8 038 | 0,06 | 5,607 % éch. 10/03/2044 | 446 | 561 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/01/2036 | 4 412 | 4 285 | 0,03 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | Stratton Mortgage Funding PLC | | | | 6,520 % éch. 25/11/2034 | 38 | 37 | 0,00 |
| 6,534 % éch. 10/01/2029 | \$ 1 900 | 1 968 | 0,02 | 6,120 % éch. 12/03/2052 | 14 315 | 18 249 | 0,14 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. | | | |
| 7,482 % éch. 29/08/2029 | £ 24 800 | 34 409 | 0,26 | 6,121 % éch. 20/07/2060 | 37 229 | 47 452 | 0,36 | 6,190 % éch. 25/07/2034 | 80 | 79 | 0,00 |
| Santander UK PLC | | | | Towd Point Mortgage Funding PLC | | | | Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc. | | | |
| 5,770 % éch. 12/02/2027 | 16 900 | 21 582 | 0,16 | 6,365 % éch. 20/10/2051 | 10 235 | 13 061 | 0,10 | 5,270 % éch. 25/02/2035 | 252 | 238 | 0,00 |
| Standard Chartered PLC | | | | 6,571 % éch. 20/07/2045 | 18 730 | 23 943 | 0,18 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | |
| 0,991 % éch. 12/01/2025 | \$ 13 400 | 13 384 | 0,10 | Trinity Square PLC | | | | 5,077 % éch. 25/01/2032 | 12 | 12 | 0,00 |
| 1,822 % éch. 23/11/2025 | 28 100 | 27 070 | 0,21 | 6,070 % éch. 15/07/2059 | 13 065 | 16 654 | 0,13 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust | | | |
| 2,608 % éch. 12/01/2028 | 12 700 | 11 623 | 0,09 | Twin Bridges PLC | | | | 5,590 % éch. 25/11/2036 | 30 | 13 | 0,00 |
| 2,678 % éch. 29/06/2032 | 600 | 488 | 0,00 | 6,070 % éch. 12/03/2055 | 10 000 | 12 701 | 0,10 | CSAB Mortgage-Backed Trust | | | |
| TP ICAP Finance PLC | | | | Uropa Securities PLC | | | | 6,672 % éch. 25/06/2036 | 198 | 57 | 0,00 |
| 2,625 % éch. 18/11/2028 | £ 9 800 | 10 465 | 0,08 | 5,540 % éch. 10/10/2040 | 45 | 56 | 0,00 | Delta Funding Home Equity Loan Trust | | | |
| | | 304 365 | 2,33 | Warwick Finance Residential Mortgages PLC | | | | 6,116 % éch. 15/08/2030 | 8 | 8 | 0,00 |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES | | | | 0,000 % éch. 21/12/2049 (c) | | | | Ellington Loan Acquisition Trust | | | |
| NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | 6,170 % éch. 21/12/2049 | | | | 6,570 % éch. 25/05/2037 | | | |
| Alba PLC | | | | 6,870 % éch. 21/12/2049 | 7 280 | 9 204 | 0,07 | | | | |
| 4,085 % éch. 15/12/2038 | € 90 | 96 | 0,00 | 7,370 % éch. 21/12/2049 | 3 640 | 4 576 | 0,04 | | | | |
| 5,509 % éch. 15/12/2038 | £ 4 122 | 5 121 | 0,04 | 7,870 % éch. 21/12/2049 | 2 080 | 2 606 | 0,02 | | | | |
| Brass PLC | | | | 8,370 % éch. 21/12/2049 | 2 080 | 2 561 | 0,02 | | | | |
| 5,940 % éch. 16/11/2066 | 2 977 | 3 802 | 0,03 | | | 379 595 | 2,90 | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Bon du Trésor britannique | | | | | | | |
| | | | | 0,625 % éch. 22/10/2050 | 46 810 | 26 357 | 0,20 | | | | |
| | | | | 1,250 % éch. 31/07/2051 | 31 025 | 21 078 | 0,16 | | | | |
| | | | | 1,500 % éch. 31/07/2053 (i) | 11 300 | 8 034 | 0,06 | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| EMC Mortgage Loan Trust | | | | New Century Home Equity Loan Trust | | | | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 6,210 % éch. 25/05/2040 | \$ 11 | \$ 11 | 0,00 | 3,699 % éch. 20/06/2031 | \$ 163 | \$ 147 | 0,00 | 5,815 % éch. 25/01/2037 | \$ 4 875 | \$ 4 705 | 0,04 |
| Encore Credit Receivables Trust | | | | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | | | | | | | |
| 6,370 % éch. 25/01/2036 | 6 000 | 5 698 | 0,04 | 6,100 % éch. 25/02/2036 | 3 934 | 3 533 | 0,03 | | | | |
| Fieldstone Mortgage Investment Trust | | | | Nomura Resecuritization Trust | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 5,697 % éch. 25/11/2036 | 1 992 | 1 154 | 0,01 | 3,950 % éch. 26/12/2037 | 948 | 805 | 0,01 | 7-Eleven, Inc. | | | |
| First Franklin Mortgage Loan Trust | | | | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | 0,800 % éch. 10/02/2024 | 12 300 | 12 231 | 0,09 |
| 5,690 % éch. 25/12/2037 | 2 395 | 2 262 | 0,02 | 2,907 % éch. 25/01/2036 | 109 | 107 | 0,00 | American Tower Corp. | | | |
| Fremont Home Loan Trust | | | | 5,810 % éch. 25/01/2037 | 1 354 | 478 | 0,00 | 2,950 % éch. 15/01/2025 | 14 600 | 14 254 | 0,11 |
| 5,605 % éch. 25/10/2036 | 2 130 | 1 870 | 0,01 | 6,010 % éch. 25/05/2036 | 3 600 | 3 394 | 0,03 | 3,800 % éch. 15/08/2029 | 7 400 | 7 033 | 0,05 |
| 5,610 % éch. 25/01/2037 | 2 329 | 1 148 | 0,01 | Option One Mortgage Loan Trust | | | | Aviation Capital Group LLC | | | |
| 6,180 % éch. 25/06/2035 | 4 763 | 4 569 | 0,04 | 5,610 % éch. 25/01/2037 | 709 | 443 | 0,00 | 4,125 % éch. 01/08/2025 | 23 600 | 22 924 | 0,18 |
| GSAA Home Equity Trust | | | | 5,610 % éch. 25/03/2037 | 2 630 | 2 007 | 0,02 | Bank of America Corp. | | | |
| 5,930 % éch. 25/04/2047 | 303 | 145 | 0,00 | 5,650 % éch. 25/04/2037 | 14 222 | 6 789 | 0,05 | 1,949 % éch. 27/10/2026 | € 17 600 | 18 883 | 0,14 |
| 5,950 % éch. 25/06/2036 | 2 762 | 790 | 0,01 | 5,690 % éch. 25/04/2037 | 3 711 | 2 594 | 0,02 | 3,384 % éch. 02/04/2026 | \$ 11 800 | 11 483 | 0,09 |
| 6,070 % éch. 25/03/2037 | 283 | 111 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/05/2037 | 4 639 | 2 748 | 0,02 | 4,916 % éch. 22/09/2026 | € 6 200 | 6 880 | 0,05 |
| 6,070 % éch. 25/05/2047 | 107 | 65 | 0,00 | 6,150 % éch. 25/11/2034 | 47 | 46 | 0,00 | 4,962 % éch. 24/08/2025 | 15 400 | 17 090 | 0,13 |
| GSAMP Trust | | | | 6,340 % éch. 25/05/2035 | 3 867 | 3 235 | 0,03 | 5,202 % éch. 25/04/2029 | \$ 27 100 | 27 285 | 0,21 |
| 5,600 % éch. 25/12/2046 | 7 911 | 4 231 | 0,03 | Owin Mortgage Loan Trust | | | | Bayer U.S. Finance LLC | | | |
| 5,610 % éch. 25/12/2036 | 5 827 | 3 064 | 0,02 | 5,757 % éch. 25/05/2037 | 1 551 | 1 193 | 0,01 | 4,250 % éch. 15/12/2025 | 5 700 | 5 557 | 0,04 |
| 5,700 % éch. 25/12/2046 | 6 932 | 3 438 | 0,03 | Park Place Securities, Inc. | | | | British Airways Pass-Through Trust | | | |
| 5,750 % éch. 25/06/2036 | 119 | 115 | 0,00 | 6,205 % éch. 25/09/2035 | 164 | 160 | 0,00 | 3,300 % éch. 15/06/2034 | 5 271 | 4 696 | 0,04 |
| 5,970 % éch. 25/05/2046 | 442 | 413 | 0,00 | People's Choice Home Loan Securities Trust | | | | Broadcom, Inc. | | | |
| 6,145 % éch. 25/11/2035 | 2 179 | 2 065 | 0,02 | 6,820 % éch. 25/01/2035 | 97 | 93 | 0,00 | 2,450 % éch. 15/02/2031 | 200 | 171 | 0,00 |
| Home Equity Asset Trust | | | | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | Charter Communications Operating LLC | | | |
| 6,030 % éch. 25/08/2036 | 337 | 329 | 0,00 | 5,340 % éch. 25/01/2037 | 15 587 | 5 287 | 0,04 | 3,750 % éch. 15/02/2028 | 10 900 | 10 298 | 0,08 |
| 6,390 % éch. 25/02/2033 | 2 | 2 | 0,00 | 5,879 % éch. 25/06/2037 | 19 229 | 5 276 | 0,04 | 3,850 % éch. 01/04/2061 | 5 100 | 3 183 | 0,02 |
| Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | | 5,893 % éch. 25/06/2037 | 9 958 | 2 739 | 0,02 | 4,500 % éch. 01/02/2024 | 3 800 | 3 794 | 0,03 |
| 5,630 % éch. 25/11/2036 | 5 955 | 5 210 | 0,04 | 6,170 % éch. 25/08/2032 | 1 | 1 | 0,00 | 5,125 % éch. 01/07/2049 | 600 | 488 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/04/2037 | 3 007 | 2 576 | 0,02 | Residential Asset Mortgage Products Trust | | | | 6,384 % éch. 23/10/2035 | 6 000 | 6 097 | 0,05 |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | | 5,910 % éch. 25/12/2036 | 449 | 434 | 0,00 | 7,289 % éch. 01/02/2024 | 7 700 | 7 700 | 0,06 |
| 6,010 % éch. 25/02/2036 | 1 836 | 1 794 | 0,01 | 6,150 % éch. 25/12/2035 | 3 448 | 3 024 | 0,02 | Citigroup, Inc. | | | |
| Humboldt Americas LLC | | | | Residential Asset Securities Corp. Trust | | | | 3,290 % éch. 17/03/2026 (h) | 33 100 | 32 241 | 0,25 |
| 0,000 % éch. 31/07/2022 | COP 20 000 000 | 4 478 | 0,03 | 6,175 % éch. 25/11/2035 | 600 | 576 | 0,00 | Corebridge Financial, Inc. | | | |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | | Saxon Asset Securities Trust | | | | 3,500 % éch. 04/04/2025 | 7 500 | 7 317 | 0,06 |
| 5,690 % éch. 25/08/2036 | \$ 2 679 | 1 875 | 0,01 | 5,670 % éch. 25/05/2047 | 7 795 | 6 807 | 0,05 | Credit Suisse AG AT1 Claim | 1 200 | 144 | 0,00 |
| 5,730 % éch. 25/08/2036 | 168 | 167 | 0,00 | 5,780 % éch. 25/09/2037 | 2 011 | 1 898 | 0,02 | Dell International LLC | | | |
| 5,740 % éch. 25/08/2036 | 8 000 | 7 272 | 0,06 | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | | 6,020 % éch. 15/06/2026 | 1 407 | 1 441 | 0,01 |
| 5,950 % éch. 25/04/2036 | 4 535 | 4 430 | 0,03 | 5,570 % éch. 25/12/2036 | 5 | 3 | 0,00 | Doctors Co. An Interinsurance Exchange | | | |
| Lehman ABS Mortgage Loan Trust | | | | 5,590 % éch. 25/12/2036 | 81 | 19 | 0,00 | 4,500 % éch. 18/01/2032 | 3 900 | 3 110 | 0,02 |
| 5,560 % éch. 25/06/2037 | 88 | 56 | 0,00 | 5,600 % éch. 25/05/2037 | 144 | 106 | 0,00 | Energy Transfer LP | | | |
| Lehman XS Trust | | | | 6,190 % éch. 25/10/2035 | 523 | 432 | 0,00 | 4,500 % éch. 15/04/2024 | 1 300 | 1 295 | 0,01 |
| 5,022 % éch. 25/04/2037 | 1 | 3 | 0,00 | 6,295 % éch. 25/10/2035 | 2 208 | 2 030 | 0,02 | Ford Motor Credit Co. LLC | | | |
| Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | SG Mortgage Securities Trust | | | | 2,748 % éch. 14/06/2024 | £ 2 600 | 3 270 | 0,02 |
| 5,770 % éch. 25/05/2036 | 3 678 | 1 982 | 0,02 | 5,790 % éch. 25/07/2036 | 3 109 | 676 | 0,01 | 2,900 % éch. 16/02/2028 | \$ 700 | 629 | 0,00 |
| 6,030 % éch. 25/10/2034 | 538 | 515 | 0,00 | SLM Student Loan Trust | | | | 3,375 % éch. 13/11/2025 | 2 700 | 2 585 | 0,02 |
| 6,745 % éch. 25/02/2035 | 6 545 | 6 387 | 0,05 | 4,356 % éch. 25/10/2039 | € 150 | 154 | 0,00 | 3,664 % éch. 08/09/2024 | 1 100 | 1 083 | 0,01 |
| Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Authority | | | | 4,475 % éch. 15/12/2033 | 832 | 851 | 0,01 | 3,815 % éch. 02/11/2027 | 1 400 | 1 308 | 0,01 |
| 5,048 % éch. 01/12/2034 | 6 600 | 6 759 | 0,05 | Soundview Home Loan Trust | | | | 4,389 % éch. 08/01/2026 | 1 000 | 973 | 0,01 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | | 5,620 % éch. 25/03/2037 | \$ 545 | 508 | 0,00 | 4,687 % éch. 09/06/2025 | 600 | 590 | 0,00 |
| 5,670 % éch. 25/08/2036 | 16 133 | 5 930 | 0,05 | 5,640 % éch. 25/07/2037 | 1 762 | 1 506 | 0,01 | 5,584 % éch. 18/03/2024 | 2 400 | 2 397 | 0,02 |
| MASTR Specialized Loan Trust | | | | 5,640 % éch. 25/08/2037 | 242 | 204 | 0,00 | GA Global Funding Trust | | | |
| 7,120 % éch. 25/06/2043 | 183 | 191 | 0,00 | 5,650 % éch. 25/07/2037 | 148 | 127 | 0,00 | 2,250 % éch. 06/01/2027 | 9 400 | 8 543 | 0,07 |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | 5,670 % éch. 25/06/2037 | 6 217 | 4 382 | 0,03 | GLP Capital LP | | | |
| 5,630 % éch. 25/09/2037 | 12 | 2 | 0,00 | 5,680 % éch. 25/06/2037 | 11 991 | 7 918 | 0,06 | 5,250 % éch. 01/06/2025 | 1 500 | 1 496 | 0,01 |
| 6,190 % éch. 25/05/2036 | 166 | 163 | 0,00 | 5,875 % éch. 25/12/2036 | 5 895 | 5 749 | 0,04 | 5,300 % éch. 15/01/2029 | 2 500 | 2 487 | 0,02 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | 5,970 % éch. 25/10/2036 | 8 229 | 7 708 | 0,06 | Goldman Sachs Group, Inc. | | | |
| 5,530 % éch. 25/05/2037 | 218 | 185 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/11/2036 | 5 166 | 4 863 | 0,04 | 4,452 % éch. 30/04/2024 | € 18 600 | 20 555 | 0,16 |
| 5,600 % éch. 25/01/2037 | 2 591 | 1 151 | 0,01 | 6,220 % éch. 25/03/2036 | 822 | 806 | 0,01 | 4,956 % éch. 07/02/2025 | 6 800 | 7 519 | 0,06 |
| 5,610 % éch. 25/10/2036 | 2 988 | 1 290 | 0,01 | 6,370 % éch. 25/10/2037 | 4 995 | 3 924 | 0,03 | 6,079 % éch. 24/01/2025 | \$ 19 000 | 18 993 | 0,15 |
| 5,700 % éch. 25/10/2036 | 10 069 | 5 278 | 0,04 | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust | | | | HCA, Inc. | | | |
| 5,720 % éch. 25/07/2036 | 471 | 414 | 0,00 | 5,076 % éch. 25/12/2036 | 223 | 212 | 0,00 | 5,375 % éch. 01/09/2026 | 2 170 | 2 181 | 0,02 |
| 5,790 % éch. 25/09/2036 | 4 297 | 1 838 | 0,01 | Structured Asset Investment Loan Trust | | | | JPMorgan Chase & Co. | | | |
| 5,970 % éch. 25/04/2036 | 4 357 | 4 088 | 0,03 | 6,090 % éch. 25/01/2036 | 2 786 | 2 565 | 0,02 | 2,595 % éch. 24/02/2026 | 21 600 | 20 929 | 0,16 |
| 6,145 % éch. 25/09/2035 | 477 | 447 | 0,00 | 6,745 % éch. 25/11/2034 | 1 953 | 1 944 | 0,02 | 4,080 % éch. 26/04/2026 | 33 800 | 33 268 | 0,25 |
| 7,720 % éch. 25/03/2033 | 47 | 45 | 0,00 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | | Lehman Brothers Holdings, Inc. | | | |
| 9,270 % éch. 25/02/2047 | 1 253 | 1 021 | 0,01 | 5,605 % éch. 25/07/2036 | 136 | 136 | 0,00 | 0,000 % éch. 25/05/2010 ^ | 8 800 | 15 | 0,00 |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | | 6,957 % éch. 25/04/2035 | 5 | 5 | 0,00 | 5,625 % éch. 24/01/2013 ^ | 12 700 | 25 | 0,00 |
| 5,640 % éch. 25/04/2037 | 3 523 | 1 833 | 0,01 | Terwin Mortgage Trust | | | | 6,200 % éch. 26/09/2014 ^ | 9 800 | 20 | 0,00 |
| 5,700 % éch. 25/04/2037 | 10 771 | 5 612 | 0,04 | 6,410 % éch. 25/11/2033 | 4 | 4 | 0,00 | 7,875 % éch. 08/05/2018 ^ | £ 14 000 | 86 | 0,00 |
| Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust | | | | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. | | | | Morgan Stanley | | | |
| 5,520 % éch. 25/11/2036 | 2 | 1 | 0,00 | 5,169 % éch. 01/04/2041 | 11 000 | 11 388 | 0,09 | 2,103 % éch. 08/05/2026 | € 30 000 | 32 401 | 0,25 |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust | | | | 2,630 % éch. 18/02/2026 | \$ 11 600 | 11 232 | 0,09 |
| 5,750 % éch. 25/04/2037 | 103 | 50 | 0,00 | 5,620 % éch. 25/01/2037 | 2 580 | 2 176 | 0,02 | Organon & Co. | | | |
| 5,930 % éch. 25/02/2037 | 174 | 37 | 0,00 | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust | | | | 2,875 % éch. 30/04/2028 | € 3 400 | 3 459 | 0,03 |
| 6,000 % éch. 25/02/2037 | 131 | 74 | 0,00 | 4,290 % éch. 25/10/2036 | 48 | 17 | 0,00 | 4,125 % éch. 30/04/2028 | \$ 4 900 | 4 515 | 0,03 |
| 6,190 % éch. 25/04/2037 | 292 | 82 | 0,00 | | | | | Pacific Gas & Electric Co. | | | |
| | | | | | | | | 2,100 % éch. 01/08/2027 | 500 | 451 | 0,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN | | | | | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| Fannie Mae | | | | 5,680 % éch. 01/06/2028 | \$ 2 | \$ 2 | 0,00 | (0,246) % éch. | | | |
| 3,000 % éch. 01/03/2060 | \$ 7 337 | \$ 6 467 | 0,05 | 6,220 % éch. 01/12/2028 | 33 | 33 | 0,00 | 04/03/2024 (c)(d) | ¥30 900 000 | \$ 219 241 | 1,68 |
| 3,500 % éch. 01/01/2059 | 22 547 | 20 482 | 0,16 | Tennessee Valley Authority | | | | (0,245) % éch. | | | |
| 4,560 % éch. 01/08/2036 | 1 | 1 | 0,00 | 5,880 % éch. 01/04/2036 | 500 | 572 | 0,01 | 04/03/2024 (c)(d) | 26 021 000 | 184 624 | 1,41 |
| 5,248 % éch. 01/06/2035 | 2 | 2 | 0,00 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | | (0,242) % éch. | 8 000 000 | 56 761 | 0,43 |
| 5,260 % éch. 25/05/2035 | 1 | 1 | 0,00 | 2,500 % éch. 01/05/2030 - 01/01/2052 | 55 541 | 47 576 | 0,36 | 04/03/2024 (c)(d) | 29 120 000 | 206 602 | 1,58 |
| 5,503 % éch. 25/12/2036 | 167 | 163 | 0,00 | 3,000 % éch. 01/01/2027 - 01/06/2051 | 25 690 | 23 040 | 0,18 | (0,233) % éch. | 15 635 000 | 110 928 | 0,85 |
| 5,563 % éch. 25/03/2034 | 25 | 25 | 0,00 | 3,500 % éch. 01/11/2034 - 01/07/2050 | 31 175 | 29 254 | 0,22 | 26/02/2024 (c)(d) | 29 120 000 | 206 602 | 1,58 |
| 5,593 % éch. 25/08/2034 | 5 | 5 | 0,00 | 4,000 % éch. 01/01/2026 - 01/10/2053 | 230 565 | 218 343 | 1,67 | (0,231) % éch. | 29 120 000 | 206 602 | 1,58 |
| 5,620 % éch. 01/12/2034 | 33 | 33 | 0,00 | 4,500 % éch. 01/04/2024 - 01/10/2053 | 362 280 | 351 441 | 2,69 | 26/02/2024 (c)(d) | 29 120 000 | 206 602 | 1,58 |
| 5,649 % éch. 01/10/2034 | 14 | 14 | 0,00 | 5,500 % éch. 01/01/2035 - 01/09/2053 | 153 792 | 154 452 | 1,18 | (0,218) % éch. | 15 635 000 | 110 928 | 0,85 |
| 5,802 % éch. 25/09/2042 - 25/03/2044 | 38 | 38 | 0,00 | 6,500 % éch. 01/06/2036 - 01/09/2053 | 101 703 | 104 258 | 0,80 | 19/02/2024 (c)(d) | 29 358 000 | 208 284 | 1,59 |
| 5,840 % éch. 01/08/2033 | 20 | 20 | 0,00 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | (0,216) % éch. | 28 633 000 | 203 117 | 1,55 |
| 5,852 % éch. 25/06/2029 - 25/06/2036 | 191 | 189 | 0,00 | 2,500 % éch. 01/01/2054 | 238 050 | 202 693 | 1,55 | (0,212) % éch. | 28 633 000 | 203 117 | 1,55 |
| 6,000 % éch. 25/04/2043 - 25/07/2044 | 562 | 565 | 0,00 | 3,500 % éch. 01/01/2054 | 73 900 | 67 871 | 0,52 | 22/01/2024 (c)(d) | 9 998 000 | 70 924 | 0,54 |
| 6,021 % éch. 01/11/2034 | 234 | 241 | 0,00 | 4,000 % éch. 01/01/2054 | 396 900 | 375 737 | 2,87 | (0,198) % éch. | 6 462 000 | 45 845 | 0,35 |
| 6,128 % éch. 01/06/2043 | 3 | 3 | 0,00 | 4,500 % éch. 01/01/2054 | 284 860 | 276 324 | 2,11 | (0,197) % éch. | 11 389 000 | 80 791 | 0,62 |
| 6,129 % éch. 01/11/2042 - 01/10/2044 | 42 | 40 | 0,00 | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 882 000 | 872 887 | 6,68 | (0,184) % éch. | 27 064 000 | 192 034 | 1,47 |
| 6,295 % éch. 01/08/2035 | 69 | 69 | 0,00 | 5,500 % éch. 01/01/2054 | 366 900 | 368 547 | 2,82 | 11/03/2024 (c)(d) | 4 436 000 | 31 476 | 0,24 |
| 6,329 % éch. 01/09/2040 | 11 | 10 | 0,00 | 6,000 % éch. 01/01/2054 | 673 950 | 684 360 | 5,23 | 11/03/2024 (c)(d) | 4 436 000 | 31 476 | 0,24 |
| 6,500 % éch. 01/11/2036 | 75 | 76 | 0,00 | 6,500 % éch. 01/01/2054 | 972 200 | 996 265 | 7,62 | | | 2 339 586 | 17,89 |
| 6,633 % éch. 01/12/2030 | 1 | 1 | 0,00 | | | | | Total des Instruments à court terme | 2 454 586 | 18,77 | |
| 6,825 % éch. 01/01/2033 | 12 | 12 | 0,00 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMERICAIN | | | | | | | |
| 7,000 % éch. 25/07/2042 | 64 | 67 | 0,00 | Obligations du Trésor américain | | | | | | | |
| 7,356 % éch. 01/04/2033 | 31 | 31 | 0,00 | 1,375 % éch. 15/11/2040 | 61 050 | 40 534 | 0,31 | Total des Valeurs mobilières | \$ 14 935 571 | 114,21 | |
| 7,420 % éch. 01/04/2033 | 49 | 49 | 0,00 | 1,625 % éch. 15/11/2050 | 117 170 | 69 844 | 0,54 | | | | |
| Freddie Mac | | | | 1,875 % éch. 15/02/2041 | 205 300 | 147 712 | 1,13 | ACTIONS | | | |
| 3,000 % éch. 01/11/2026 - 01/04/2045 | 333 | 306 | 0,00 | 1,875 % éch. 15/02/2051 | 100 | 63 | 0,00 | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 3,500 % éch. 01/08/2026 - 01/04/2049 | 4 980 | 4 656 | 0,04 | 2,000 % éch. 15/08/2051 | 7 100 | 4 639 | 0,04 | PIMCO Funds: Global | | | |
| 4,000 % éch. 01/09/2024 - 01/09/2041 | 3 | 3 | 0,00 | 2,875 % éch. 15/05/2052 | 26 900 | 21 425 | 0,16 | Investors Series plc | | | |
| 5,000 % éch. 15/08/2035 - 01/12/2039 | 422 | 423 | 0,00 | 3,250 % éch. 15/05/2042 | 200 | 176 | 0,00 | - Fonds PIMCO | | | |
| 5,500 % éch. 01/06/2037 - 01/10/2039 | 42 | 44 | 0,00 | 4,000 % éch. 15/11/2052 | 38 080 | 37 579 | 0,29 | Emerging Markets | | | |
| 5,730 % éch. 25/08/2031 | 0 | 0 | 0,00 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e) | | | | Opportunities Fund (f) | | | |
| 5,732 % éch. 25/09/2031 | 37 | 37 | 0,00 | 0,125 % éch. 15/04/2025 | 93 207 | 89 889 | 0,69 | Fund (f) | | | |
| 5,750 % éch. 01/09/2037 | 93 | 95 | 0,00 | 0,125 % éch. 15/07/2031 | 36 505 | 32 473 | 0,25 | PIMCO Funds: Global | | | |
| 5,885 % éch. 01/10/2034 | 17 | 17 | 0,00 | 0,125 % éch. 15/01/2032 | 9 434 | 8 291 | 0,06 | Investors Series plc | | | |
| 5,903 % éch. 15/12/2031 | 0 | 0 | 0,00 | 0,250 % éch. 15/01/2025 | 132 629 | 128 747 | 0,98 | - Fonds PIMCO | | | |
| 5,933 % éch. 15/10/2040 | 1 538 | 1 510 | 0,01 | 0,375 % éch. 15/01/2027 | 44 580 | 42 374 | 0,32 | European High Yield | | | |
| 5,953 % éch. 15/06/2041 | 2 258 | 2 225 | 0,02 | 0,375 % éch. 15/07/2027 | 164 | 155 | 0,00 | Bond Fund (f) | | | |
| 5,981 % éch. 01/08/2035 | 18 | 18 | 0,00 | 0,500 % éch. 15/01/2028 | 89 341 | 84 566 | 0,65 | PIMCO Funds: Global | | | |
| 6,000 % éch. 15/04/2036 | 1 119 | 1 174 | 0,01 | 0,625 % éch. 15/07/2032 | 5 612 | 5 131 | 0,04 | Investors Series plc | | | |
| 6,021 % éch. 01/09/2035 | 5 | 5 | 0,00 | 0,750 % éch. 15/07/2028 | 9 438 | 9 035 | 0,07 | - Fonds PIMCO | | | |
| 6,053 % éch. 15/12/2037 | 55 | 55 | 0,00 | 1,125 % éch. 15/01/2033 | 94 924 | 89 865 | 0,69 | US Dollar Short-Term Fund (f) | | | |
| 6,212 % éch. 25/10/2044 - 25/02/2045 | 863 | 786 | 0,01 | 1,750 % éch. 15/01/2028 | 25 995 | 25 843 | 0,20 | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | | | |
| 6,344 % éch. 01/10/2033 | 17 | 17 | 0,00 | 2,375 % éch. 15/01/2025 | 19 914 | 19 759 | 0,15 | PIMCO Select Funds plc | | | |
| 6,412 % éch. 25/07/2044 | 19 | 18 | 0,00 | 2,375 % éch. 15/01/2027 | 1 526 | 1 540 | 0,01 | - Fonds PIMCO | | | |
| 7,000 % éch. 01/10/2037 | 6 | 7 | 0,00 | 2,500 % éch. 15/01/2029 | 57 752 | 59 723 | 0,46 | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | | | |
| Ginnie Mae | | | | 3,875 % éch. 15/04/2029 | 37 057 | 40 864 | 0,31 | PIMCO Specialty Funds | | | |
| 2,750 % éch. 20/11/2026 | 0 | 0 | 0,00 | Billets du Trésor américain | | | | Ireland p.l.c. - Fonds | | | |
| 3,000 % éch. 20/07/2046 - 20/05/2047 | 339 | 322 | 0,00 | 0,375 % éch. 30/09/2027 | 2 400 | 2 106 | 0,02 | PIMCO China Bond | | | |
| 3,625 % éch. 20/01/2025 - 20/01/2030 | 4 | 3 | 0,00 | 0,750 % éch. 31/01/2028 | 100 | 88 | 0,00 | Fund (f) | | | |
| 3,875 % éch. 20/04/2027 - 20/05/2030 | 6 | 7 | 0,00 | 2,500 % éch. 31/03/2027 | 4 600 | 4 397 | 0,03 | PIMCO Euro Short | | | |
| 4,000 % éch. 20/04/2030 | 4 | 4 | 0,00 | 2,875 % éch. 30/04/2025 | 96 500 | 94 408 | 0,72 | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| 4,500 % éch. 15/04/2039 | 22 | 22 | 0,00 | 3,500 % éch. 15/02/2033 | 25 500 | 24 739 | 0,19 | PIMCO Euro Short | | | |
| 5,000 % éch. 20/04/2038 | 11 | 12 | 0,00 | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| 5,500 % éch. 20/08/2035 - 15/02/2039 | 153 | 156 | 0,00 | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| 6,187 % éch. 20/01/2066 | 1 380 | 1 372 | 0,01 | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| 6,267 % éch. 20/08/2066 | 3 721 | 3 705 | 0,03 | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| Ginnie Mae, TBA | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| 3,000 % éch. 01/02/2054 | 85 300 | 77 296 | 0,59 | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| Administration des petites entreprises | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| 4,760 % éch. 01/09/2025 | 7 | 7 | 0,00 | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| 4,840 % éch. 01/05/2025 | 3 | 3 | 0,00 | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| 5,090 % éch. 01/10/2025 | 3 | 3 | 0,00 | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| 5,110 % éch. 01/04/2025 | 1 | 1 | 0,00 | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| 5,490 % éch. 01/05/2028 | 11 | 11 | 0,00 | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| 5,600 % éch. 01/09/2028 | 4 | 4 | 0,00 | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | Maturity UCITS ETF (f) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Euro Short | | | |
| | | | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|--|---------------------|--|--|---------------------|
| BPS | 5,470 % | 02/01/2024 | 03/01/2024 | \$ 76 000 | Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 31/05/2029 | \$ (77 604) | \$ 76 000 | \$ 76 012 | 0,58 |
| CEW | 4,960 | 27/12/2023 | 03/01/2024 | CAD 100 000 | Province d'Alberta 2,050 % éch. 01/06/2030 Province du Québec 2,850 % éch. 01/12/2053 | (15 562) | 75 838 | 75 933 | 0,58 |
| FICC | 4,970 | 28/12/2023 | 04/01/2024 | 110 000 | Province de l'Ontario 2,050 % - 2,650 % éch. 02/06/2030 - 02/12/2050 | (84 805) | 83 422 | 83 527 | 0,64 |
| | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 14 614 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | (14 906) | 14 614 | 14 617 | 0,11 |
| | 5,330 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 78 700 | Billets du Trésor américain 1,375 % - 1,500 % éch. 30/11/2028 - 31/12/2028 | (80 274) | 78 700 | 78 700 | 0,60 |
| IND | 5,215 | 18/12/2023 | 03/01/2024 | £ 34 000 | Bon du Trésor britannique indexé sur l'inflation 3,750 % éch. 22/10/2053 | (45 099) | 43 343 | 43 421 | 0,33 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (380 243) | \$ 371 917 | \$ 372 210 | 2,84 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois mars | Long | 03/2024 | 4 786 | \$ 818 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois mars | Long | 03/2025 | 4 786 | 4 314 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Court | 09/2024 | 9 572 | (6 299) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 222 | (1 031) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2025 | 10 214 | (13 397) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2024 | 832 | (132) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Long | 09/2025 | 2 550 | 3 817 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Long | 06/2024 | 8 536 | 3 496 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2024 | 2 601 | (1 662) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Long | 12/2025 | 2 553 | 3 808 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars | Court | 03/2024 | 1 037 | (755) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 4 222 | (9 529) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 698 | 1 981 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 1 366 | (2 975) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 2 168 | 10 404 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 207 | 395 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 17 | 215 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 3 106 | (13 643) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 516 | (384) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 194 | (1 590) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 1 203 | (2 835) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 2 688 | (9 917) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 643 | (2 913) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 36 | 354 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 66 | (748) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 3 863 | (33 316) | (0,26) |
| | | | | \$ (71 524) | (0,55) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (71 524) | (0,55) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 % | 20/06/2026 | \$ 800 | \$ 39 | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-39 Index à 10 ans | (1,000) % | 20/12/2032 | \$ 2 060 | \$ (27) | 0,00 |
| Indice CDX.IG-40 Index à 10 ans | (1,000) | 20/06/2033 | 63 070 | (715) | (0,01) |
| Indice CDX.IG-41 Index à 10 ans | (1,000) | 20/12/2033 | 813 500 | (9 560) | (0,07) |
| | | | | \$ (10 302) | (0,08) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Index CDX.IG-39 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2027 | \$ 1 400 | \$ 19 | 0,00 |
| Index CDX.IG-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2028 | 16 600 | 94 | 0,00 |
| Index CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 2 695 700 | 17 575 | 0,14 |
| Index iTraxx Europe Main 40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | € 48 600 | 479 | 0,00 |
| | | | | \$ 18 167 | 0,14 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,000 % | 17/06/2027 | £ 357 180 | \$ 849 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 17/06/2035 | 77 260 | (171) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 24 600 | 4 095 | 0,03 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 602 100 | 61 998 | 0,47 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 575 670 | 23 745 | 0,18 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 120 600 | (3 835) | (0,03) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,250 | 20/03/2029 | INR 7 875 990 | 110 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2029 | 2 854 640 | 101 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2034 | 1 775 710 | (125) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 17/03/2031 | ¥ 14 710 000 | (3 874) | (0,03) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050 | 15/12/2031 | 19 820 000 | (2 302) | (0,02) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,200 | 19/06/2029 | 6 440 000 | (2 013) | (0,02) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 19/06/2039 | 13 160 000 | 10 413 | 0,08 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,450 | 15/12/2051 | 770 000 | 391 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,550 | 14/09/2028 | 23 400 000 | (2 281) | (0,02) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,800 | 15/06/2052 | 3 460 000 | 3 434 | 0,03 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,850 | 20/09/2033 | 2 070 000 | (68) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 20/03/2029 | SGD 350 490 | (2 373) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/01/2028 | \$ 578 050 | (75 558) | (0,58) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2029 | 16 880 | (799) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,249 | 31/08/2024 | 178 000 | 4 926 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/12/2026 | 444 500 | 40 890 | 0,31 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,298 | 25/08/2024 | 155 100 | 4 235 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360 | 17/09/2024 | 53 950 | 1 411 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,430 | 31/03/2024 | 256 050 | (10 256) | (0,08) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,488 | 15/08/2031 | 25 600 | (3 755) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 233 690 | (27 917) | (0,21) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,518 | 20/01/2029 | 9 430 | (1 011) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 20/01/2029 | 63 600 | (6 461) | (0,05) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2024 | 610 261 | 7 206 | 0,06 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2025 | 6 500 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2027 | 632 731 | 13 551 | 0,10 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2052 | 25 110 | (1 787) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/12/2051 | 66 000 | (24 756) | (0,19) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 71 610 | (4 566) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 14 900 | (217) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 25 900 | (352) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 31 800 | (478) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,965 | 30/11/2026 | 565 100 | 13 665 | 0,10 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 17 400 | (233) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | 9 500 | (132) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 34 180 | (496) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 13 000 | (175) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 08/09/2029 | 11 300 | (276) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 10 800 | (124) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100 | 09/09/2029 | 31 000 | (667) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100 | 15/11/2032 | 42 410 | (1 067) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 14 200 | (165) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,150 | 13/05/2025 | 971 400 | 6 775 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,163 | 30/09/2029 | 37 000 | (862) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 13 700 | (154) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,200 | 13/05/2025 | 78 400 | 736 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 14 200 | (155) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 30/09/2029 | 5 200 | (122) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 16 280 | (200) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 230 900 | (28 030) | (0,21) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 31/05/2027 | 100 800 | 2 187 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 14/06/2033 | 34 000 | (689) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,454 | 30/06/2029 | 82 000 | (1 037) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 15 800 | (204) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/06/2030 | 32 300 | (176) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 2 800 | 19 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 898 208 | 39 124 | 0,30 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 16 200 | (160) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 24 600 | (225) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 31 200 | (281) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 38 900 | (314) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 22 800 | (177) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 % | 21/06/2025 | \$ 186 000 | \$ 2 602 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 314 900 | (10 179) | (0,08) |
| À payer ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2034 | 121 990 | 175 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 10 300 | (18) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 2 800 | 276 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,849 | 31/03/2030 | 15 900 | 238 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,857 | 31/03/2030 | 82 200 | 1 207 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,898 | 30/06/2029 | 66 300 | 768 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 13/09/2033 | 24 420 | 944 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,951 | 31/03/2030 | 33 000 | 694 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,981 | 30/11/2027 | 107 800 | 1 289 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,988 | 30/11/2027 | 63 700 | 777 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 | 20/03/2054 | 57 200 | (1 097) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,050 | 10/10/2028 | 77 200 | 1 466 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,159 | 31/03/2025 | 214 600 | 3 180 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 21 100 | 1 237 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 14 500 | 857 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,193 | 30/11/2027 | 193 700 | 3 878 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 21 200 | 1 340 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,228 | 30/08/2025 | 205 300 | (886) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 997 819 | (5 035) | (0,04) |
| À payer ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2034 | 197 750 | 1 903 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 9 200 | 760 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 19 900 | 1 672 | 0,01 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,235 | 04/03/2025 | 57 400 | (2 411) | (0,02) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2025 | 89 200 | (2 063) | (0,02) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2030 | 207 300 | (15 735) | (0,12) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,713 | 02/10/2029 | 81 100 | (6 009) | (0,05) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,900 | 18/12/2029 | 107 300 | (7 976) | (0,06) |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 2,500 | 28/01/2052 | 700 | (15) | 0,00 |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 3,250 | 15/03/2033 | 88 700 | 1 198 | 0,01 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 21/06/2033 | 71 300 | 1 998 | 0,02 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 21/06/2053 | 2 900 | 271 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 10/05/2025 | 1 348 900 | (2 103) | (0,02) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 01/06/2032 | 55 800 | (1 149) | (0,01) |
| À recevoir | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2033 | 143 400 | (5 479) | (0,04) |
| À payer ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,600 | 30/08/2025 | 255 100 | 1 810 | 0,01 |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,283 | 14/02/2027 | 47 000 | (2 022) | (0,02) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,294 | 10/02/2027 | 19 900 | (805) | (0,01) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,343 | 16/05/2027 | 31 300 | (1 234) | (0,01) |
| À payer ⁽⁴⁾ | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | 275 190 | 219 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 16 971 380 | 66 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,500 | 20/03/2034 | 5 365 160 | 38 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 0,528 | 17/03/2024 | 10 000 | (73) | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 3,750 | 15/06/2027 | 102 300 | (185) | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 4,000 | 14/06/2024 | 624 400 | (1 373) | (0,01) |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR NZD à 3 mois | 5,000 | 20/03/2025 | 324 700 | 253 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR NZD à 3 mois | 5,250 | 20/03/2025 | 15 800 | 27 | 0,00 |
| À payer | STIBOR SEK à 3 mois | 0,500 | 19/06/2024 | 260 100 | (992) | (0,01) |
| À payer | STIBOR SEK à 3 mois | 1,000 | 19/06/2029 | 56 700 | (573) | 0,00 |
| À recevoir | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,250 | 17/06/2030 | 128 300 | 16 631 | 0,13 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,750 | 16/03/2027 | 92 600 | (4 369) | (0,03) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,000 | 21/06/2033 | 454 100 | 3 604 | 0,03 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 15/09/2032 | 40 100 | (5) | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 15/03/2033 | 206 600 | (1 662) | (0,01) |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 15/09/2032 | 866 100 | 5 797 | 0,04 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | 766 800 | 11 446 | 0,09 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,913 | 30/01/2029 | 158 300 | (624) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,054 | 27/05/2050 | 7 450 | 3 376 | 0,03 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,064 | 17/11/2052 | 17 650 | 9 306 | 0,07 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | 12 500 | (414) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | 34 400 | (2 223) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 24 400 | (1 471) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 19 200 | (1 215) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 30/03/2024 | 76 900 | (666) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 41 000 | (2 036) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 18 100 | (888) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | 103 300 | 266 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 218 700 | 631 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 55 200 | 166 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 26/04/2024 | 32 200 | 177 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 38 500 | 178 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 32 900 | 151 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 21/09/2037 | 55 870 | (325) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 457 400 | (51 154) | (0,39) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,970 | 15/12/2033 | 21 000 | (870) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 27 600 | (1 190) | (0,01) |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 19/03/2027 | 489 180 | 5 969 | 0,05 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 15/03/2033 | 221 155 | (2 932) | (0,02) |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 1 423 870 | 78 833 | 0,60 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 26 900 | (912) | (0,01) |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 % | 20/03/2029 | € 1 249 580 | \$ 44 108 | 0,34 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 600 | 47 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,450 | 20/10/2028 | 28 200 | 1 403 | 0,01 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 1 556 600 | 22 638 | 0,17 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,535 | 18/09/2025 | 909 200 | (9 593) | (0,07) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 4,870 | 07/07/2025 | MXN 393 200 | (1 811) | (0,01) |
| | | | | | \$ 112 884 | 0,86 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 120 788 | 0,92 |

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 % | 15/07/2024 | 230 900 | \$ 462 | \$ 164 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,180 | 11/01/2024 | 49 700 | 1 420 | 5 318 | 0,04 |
| BRC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 220 900 | 298 | 6 | 0,00 |
| DUB | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 | 10/07/2024 | 1 210 100 | 3 297 | 861 | 0,01 |
| FAR | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 500 000 | 750 | 13 | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 260 000 | 402 | 7 | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 428 200 | 546 | 11 | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 408 500 | 564 | 11 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ 7 739 | \$ 6 391 | 0,05 |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BPS | Option de vente - Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052 hors cote | € 97,000 | 23/05/2025 | 26 800 | \$ 2 027 | \$ 11 007 | 0,08 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM | Option de vente - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 04/03/2024 | 18 458 | \$ (257) | \$ (537) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - USD contre TWD hors cote | 31,000 | 01/03/2024 | 43 637 | (590) | (1 255) | (0,01) |
| | | | | | \$ (847) | \$ (1 792) | (0,01) |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,310 % | 11/01/2024 | 441 600 | \$ (1 424) | \$ (10 237) | (0,08) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 5,250 | 15/07/2024 | 230 900 | (231) | (55) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 3 500 | (16) | (26) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 7 750 | (35) | (97) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 3 500 | (16) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 7 750 | (35) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 0,451 | 23/05/2025 | 26 800 | (2 027) | (10 171) | (0,08) |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,690 | 02/04/2024 | 33 700 | (265) | (9) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,690 | 02/04/2024 | 33 700 | (265) | (540) | (0,01) |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| DUB | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 % | 22/01/2024 | 19 500 | \$ (80) | \$ (62) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 19 500 | (80) | (57) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,790 | 08/04/2024 | 39 000 | (300) | (13) | 0,00 |
| FAR | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,790 | 08/04/2024 | 39 000 | (300) | (579) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 5,250 | 10/07/2024 | 1 210 100 | (1 815) | (285) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,688 | 02/04/2024 | 14 400 | (113) | (4) | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,688 | 02/04/2024 | 14 400 | (113) | (231) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,273 | 16/01/2024 | 5 300 | (23) | (15) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 5 750 | (27) | (41) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 5 450 | (24) | (70) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,723 | 16/01/2024 | 5 300 | (23) | (9) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 5 750 | (27) | 0 | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 5 450 | (24) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 6 300 | (49) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 6 300 | (49) | (100) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 | 08/04/2024 | 15 300 | (115) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 15 300 | (115) | (237) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 3 900 | (16) | (11) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 13 800 | (59) | (46) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 9 900 | (51) | (104) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 9 900 | (49) | (126) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 4 050 | (18) | (66) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 3 900 | (16) | (13) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 13 800 | (59) | (19) | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 9 900 | (51) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 9 900 | (49) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 26 600 | (61) | (93) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 26 600 | (61) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR GBP à 6 mois | À recevoir | 0,820 | 16/12/2024 | 123 600 | (873) | (147) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 24 600 | (106) | (77) | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 5 200 | (21) | (14) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 8 000 | (37) | (126) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 24 600 | (106) | (126) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 5 200 | (21) | (18) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 8 000 | (37) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 11 000 | (44) | (85) | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 1 600 | (6) | (25) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 11 000 | (44) | (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 1 600 | (6) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 9 250 | (45) | (52) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 2 400 | (11) | (16) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 5 350 | (25) | (96) | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 9 250 | (45) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 2 400 | (11) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 5 350 | (25) | 0 | 0,00 |
| UAG | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 10 200 | (43) | (27) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 10 200 | (43) | (18) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 25 300 | (123) | (128) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 25 300 | (123) | (45) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (9 876) | \$ (24 336) | (0,19) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/reçues | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 29 900 | \$ (880) | \$ (123) | \$ (1 003) | (0,01) |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) | 20/12/2028 | 30 500 | (869) | (155) | (1 024) | (0,01) |
| | | | | | \$ (1 749) | \$ (278) | \$ (2 027) | (0,02) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/reçues | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 % | 20/06/2025 | \$ 11 810 | \$ (285) | \$ 419 | \$ 134 | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 | 20/06/2025 | 17 350 | (421) | 619 | 198 | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 | 20/06/2025 | 4 020 | (97) | 143 | 46 | 0,00 |
| | | | | | \$ (803) | \$ 1 181 | \$ 378 | 0,00 |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|--|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| AZD | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,290 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 04/01/2031 | AUD 106 300 \$ | 80 086 | \$ 527 | \$ (211) | \$ 316 | 0,01 |
| CBK | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,420 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 31/07/2029 | 105 500 | 72 795 | (26) | 332 | 306 | 0,00 |
| GLM | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,423 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 01/08/2029 | 101 200 | 69 828 | (205) | 326 | 121 | 0,00 |
| MYC | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,298 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 14/10/2030 | 65 900 | 47 343 | 287 | (86) | 201 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 583 | \$ 361 | \$ 944 | 0,01 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/09/2028 | MYR 123 500 | \$ 653 | \$ (571) | \$ 82 | 0,00 |
| GST | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/09/2028 | 1 013 770 | 3 822 | (3 150) | 672 | 0,01 |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,600 | 20/09/2028 | 360 850 | (37) | (72) | (109) | 0,00 |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,750 | 20/09/2033 | 275 030 | 1 742 | (1 296) | 446 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 6 180 | \$ (5 089) | \$ 1 091 | 0,01 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 225 680 | \$ 149 555 | \$ 0 | \$ (4 468) | (0,04) | |
| | 01/2024 | NZD | 280 | 177 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 205 765 | 28 548 | 0 | (515) | 0,00 | |
| BOA | 01/2024 | £ | 36 720 | 46 562 | 0 | (250) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 490 778 | 1 401 | 0 | (14) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 35 060 597 | 237 588 | 0 | (11 262) | (0,09) | |
| | 01/2024 | \$ | 503 | MXN 8 564 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 3 645 | NOK 38 753 | 172 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 600 | CNY 4 239 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | CNH | 289 610 | \$ 39 985 | 0 | (920) | (0,01) | |
| | 03/2024 | IDR | 52 579 111 | 3 344 | 0 | (65) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 469 | IDR 7 316 971 | 5 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 22 735 | INR 1 902 402 | 47 | 0 | 0,00 | |
| | 06/2024 | KRW | 2 916 036 | \$ 2 241 | 0 | (28) | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | CAD | 25 454 | 18 809 | 0 | (497) | 0,00 | |
| | 01/2024 | DKK | 885 802 | 130 660 | 0 | (641) | (0,01) | |
| | 01/2024 | € | 2 182 038 | 2 401 917 | 0 | (9 025) | (0,07) | |
| | 01/2024 | £ | 73 997 | 93 860 | 0 | (474) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 3 075 654 | 8 744 | 0 | (144) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 20 443 153 | 139 430 | 0 | (5 669) | (0,04) | |
| | 01/2024 | KRW | 2 693 250 | 2 050 | 0 | (31) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 38 313 | AUD 57 267 | 771 | 0 | 771 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 1 200 | BRL 5 908 | 16 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 449 | CAD 1 952 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 7 522 | DKK 51 395 | 101 | (5) | 96 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 130 001 | € 118 628 | 1 122 | (51) | 1 071 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 8 066 | £ 6 324 | 13 | (17) | (4) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ | 83 | HUF 28 729 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 500 | IDR 38 668 747 | 9 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 316 358 | ¥ 46 562 600 | 14 129 | 0 | 0,11 |
| | 01/2024 | | 58 889 | ZAR 1 091 704 | 728 | 0 | 0,01 |
| | 02/2024 | TWD | 1 481 818 | \$ 46 582 | 0 | (2 390) | (0,02) |
| | 02/2024 | \$ | 1 065 | CNY 7 559 | 4 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 197 990 | \$ 27 510 | 0 | (455) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 82 393 995 | 5 376 | 33 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR | 2 761 129 | 33 095 | 29 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | 45 124 593 | 306 523 | 0 | (16 520) | (0,13) |
| | 03/2024 | TWD | 874 637 | 27 793 | 0 | (1 188) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 10 950 | CNH 79 516 | 282 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 3 192 | IDR 49 199 829 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 79 001 | INR 6 607 916 | 132 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 478 | THB 16 602 | 12 | 0 | 0,00 |
| BRC | 06/2024 | KRW | 133 024 898 | \$ 102 005 | 0 | (1 545) | (0,01) |
| | 01/2024 | | 3 036 905 | 2 350 | 5 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD | 20 075 | 12 350 | 0 | (361) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 934 | AUD 4 467 | 115 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 23 981 | CAD 32 610 | 753 | 0 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 437 | CHF 380 | 15 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 670 | PLN 2 931 | 75 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 283 | ZAR 42 518 | 39 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ | 166 090 000 | \$ 1 119 224 | 0 | (68 263) | (0,52) |
| | 03/2024 | | 37 025 407 | 251 426 | 0 | (13 637) | (0,11) |
| | 03/2024 | SGD | 1 428 | 1 085 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB | 415 | 12 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 1 099 | IDR 17 092 146 | 9 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 498 | SGD 661 | 5 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | ¥ | 8 140 195 | \$ 66 630 | 8 100 | 0 | 0,06 |
| | 05/2024 | | 5 580 000 | 45 133 | 4 834 | 0 | 0,04 |
| CBK | 06/2024 | KRW | 121 149 405 | 92 821 | 0 | (1 485) | (0,01) |
| | 01/2024 | BRL | 425 843 | 87 460 | 0 | (205) | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF | 53 783 | 61 979 | 0 | (1 956) | (0,02) |
| | 01/2024 | COP | 20 000 000 | 4 886 | 0 | (247) | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK | 70 595 | 10 233 | 0 | (231) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 25 156 | 31 899 | 0 | (171) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 1 041 415 | 2 973 | 0 | (36) | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR | 33 942 783 | 2 205 | 3 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 10 502 300 | 74 383 | 0 | (159) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 9 532 | AUD 14 175 | 142 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 283 | CAD 3 103 | 71 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 411 | CHF 358 | 15 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 20 759 | DKK 142 220 | 322 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 14 795 | € 13 614 | 247 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 8 776 | £ 6 941 | 72 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 050 | ¥ 574 200 | 25 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 60 897 | MXN 1 078 457 | 2 503 | 0 | 0,02 |
| | 01/2024 | | 446 | NOK 4 774 | 24 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 841 | PLN 19 441 | 102 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 31 146 | \$ 1 652 | 0 | (49) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 553 640 | 78 036 | 0 | (162) | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS | 72 830 | 20 004 | 0 | (268) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 63 669 | 16 908 | 0 | (247) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 1 382 | 45 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 18 761 | BRL 92 917 | 252 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 2 205 | IDR 33 951 493 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 04/2024 | | 87 460 | BRL 430 155 | 365 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 29 186 588 | \$ 22 642 | 0 | (77) | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ | 37 | KRW 47 337 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | CAD | 210 200 | \$ 158 853 | 0 | (562) | (0,01) |
| | 01/2024 | KRW | 1 754 595 | 1 350 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 16 | CNY 113 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 137 834 | \$ 19 128 | 0 | (340) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 20 612 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD | 24 712 | 18 670 | 0 | (131) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 491 | IDR 7 661 853 | 6 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 127 823 921 | \$ 98 203 | 0 | (1 298) | (0,01) |
| FAR | 01/2024 | \$ | 28 | KRW 36 132 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 06/2024 | KRW | 36 132 | \$ 28 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD | 23 592 | 15 818 | 0 | (283) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 346 515 | 254 987 | 0 | (7 833) | (0,06) |
| | 01/2024 | DKK | 799 095 | 117 876 | 0 | (573) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 34 000 | 43 434 | 91 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HKD | 5 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 50 298 600 | 357 325 | 0 | (406) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 243 | 13 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 83 890 | BRL 422 610 | 3 110 | 0 | 0,02 |
| | 01/2024 | | 8 144 | CAD 10 765 | 21 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 980 | CHF 1 735 | 83 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 098 | £ 2 432 | 2 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 68 581 | MXN 1 202 760 | 2 126 | 0 | 0,02 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 01/2024 | \$ | 1 456 | NZD 2 339 | \$ 25 | \$ 0 | \$ 25 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 34 582 | PLN 138 468 | 623 | 0 | 623 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 423 | SEK 4 285 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 3 381 | \$ 178 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL | 485 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 584 527 | 81 177 | 0 | (1 384) | (1 384) | (0,01) |
| | 03/2024 | SGD | 2 453 | 1 853 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 9 387 | IDR 144 420 161 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 9 869 | TWD 305 730 | 244 | 0 | 244 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | HUF | 6 673 185 | \$ 19 017 | 0 | (267) | (267) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 14 945 | 868 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 650 | IDR 40 775 550 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 054 | KRW 2 657 118 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | 15 389 | \$ 2 143 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 79 507 | 2 482 | 0 | (145) | (145) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 12 047 | BRL 59 086 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 159 621 638 | \$ 10 296 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 2 371 234 | 76 268 | 0 | (2 304) | (2 304) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ | 5 458 | IDR 84 268 424 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 22 193 | INR 1 855 380 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 120 | SGD 159 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 21 818 | TWD 676 362 | 551 | 0 | 551 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 129 859 293 | \$ 100 084 | 3 | (1 005) | (1 002) | (0,01) |
| | 10/2024 | ¥ | 7 740 000 | 62 332 | 5 242 | 0 | 5 242 | 0,04 |
| MBC | 01/2024 | AUD | 96 610 | 64 046 | 0 | (1 889) | (1 889) | (0,02) |
| | 01/2024 | DKK | 53 330 | 7 829 | 0 | (76) | (76) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 7 587 | 9 660 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 81 656 | 232 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 1 425 000 | 9 848 | 0 | (266) | (266) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 33 994 | DKK 234 755 | 803 | 0 | 803 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 47 834 | € 43 831 | 595 | 0 | 595 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 14 041 | £ 11 102 | 112 | 0 | 112 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 447 | HUF 539 426 | 107 | 0 | 107 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 785 | ¥ 682 000 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ | 700 018 | \$ 5 675 | 688 | 0 | 688 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 15 550 388 | 127 046 | 15 775 | 0 | 15 775 | 0,12 |
| | 03/2024 | \$ | 6 598 | CNH 46 685 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 6 658 | IDR 102 640 355 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 14 | TWD 435 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2024 | ¥ | 10 172 450 | \$ 81 581 | 6 549 | 0 | 6 549 | 0,05 |
| MYI | 01/2024 | CAD | 15 455 | 11 721 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 555 | 617 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 400 | 511 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 81 277 | 231 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 13 318 308 | 90 337 | 0 | (4 192) | (4 192) | (0,03) |
| | 01/2024 | MYR | 28 198 | 6 043 | 0 | (111) | (111) | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK | 9 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD | 26 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD | 775 | 587 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 080 | CNY 7 758 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 104 | € 994 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 756 | £ 2 158 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 0 | NOK 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 90 | NZD 143 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 761 | ZAR 13 974 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 1 659 | CNY 11 907 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 196 354 | \$ 27 228 | 0 | (506) | (506) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | 31 500 000 | 216 515 | 0 | (9 238) | (9 238) | (0,07) |
| | 03/2024 | \$ | 63 655 | IDR 981 841 514 | 113 | (99) | 14 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 73 634 048 | \$ 56 613 | 0 | (705) | (705) | (0,01) |
| RBC | 04/2024 | \$ | 98 | MXN 1 725 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | AUD | 23 608 | \$ 15 870 | 0 | (242) | (242) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 1 501 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD | 507 | 314 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 165 | CAD 1 558 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 501 | NZD 806 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | € | 98 436 | \$ 107 414 | 0 | (1 349) | (1 349) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 280 669 | 355 012 | 0 | (2 796) | (2 796) | (0,02) |
| | 01/2024 | MYR | 401 032 | 85 855 | 0 | (1 658) | (1 658) | (0,01) |
| | 01/2024 | SEK | 29 050 | 2 797 | 0 | (86) | (86) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 112 | CNY 7 992 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 772 | ¥ 112 500 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | 7 958 | \$ 1 109 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 192 772 | 26 628 | 0 | (600) | (600) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR | 26 614 760 | 1 696 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB | 957 289 | 27 695 | 0 | (537) | (537) | (0,01) |
| | 03/2024 | TWD | 1 555 986 | 50 077 | 0 | (1 481) | (1 481) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 5 624 | IDR 87 193 901 | 49 | (18) | 31 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 48 301 | INR 4 039 389 | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 29 888 | TWD 929 615 | 915 | 0 | 915 | 0,01 |
| | 06/2024 | KRW | 62 476 417 | \$ 48 130 | 0 | (503) | (503) | 0,00 |
| SOG | 02/2024 | RON | 1 298 | 283 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| SSB | 01/2024 | \$ 769 | £ 611 | \$ 10 | \$ 0 | \$ 10 | 0,00 |
| TOR | 03/2024 | CNH 93 229 | \$ 12 913 | 0 | (255) | (255) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 22 667 083 | 1 436 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD 505 | 381 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | CAD 139 774 | 103 045 | 0 | (2 969) | (2 969) | (0,02) |
| | 01/2024 | DKK 374 675 | 55 005 | 0 | (533) | (533) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 116 642 | 147 547 | 0 | (1 153) | (1 153) | (0,01) |
| | 01/2024 | HKD 7 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 295 156 | 803 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 1 403 127 | 9 578 | 0 | (381) | (381) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 47 854 | 2 703 | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 20 639 | NOK 220 164 | 1 043 | 0 | 1 043 | 0,01 |
| | 01/2024 | 8 727 | ZAR 166 587 | 370 | 0 | 370 | 0,00 |
| | 03/2024 | CZK 40 670 | \$ 1 827 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | | | | \$ 75 377 | \$ (192 352) | \$ (116 975) | (0,89) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ 12 098 | CAD 16 451 | \$ 380 | \$ 0 | \$ 380 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | 10 873 | 14 780 | 337 | 0 | 337 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 302 | 1 762 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 1 269 | 1 674 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 12 042 | 16 334 | 347 | 0 | 347 | 0,00 |
| | | | | \$ 1 099 | \$ 0 | \$ 1 099 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, Investisseurs en CHF (couverte) de capitalisation, E en CHF (couverte) de capitalisation, W en CHF (couverte) de capitalisation et W en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 122 | \$ 142 | \$ 0 | \$ (3) | \$ (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 019 | CHF 875 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF 314 | \$ 361 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 27 666 | CHF 24 130 | 1 020 | 0 | 1 020 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | CHF 534 | \$ 614 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 177 752 | CHF 154 864 | 6 344 | 0 | 6 344 | 0,05 |
| GLM | 01/2024 | CHF 195 | \$ 223 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 246 528 | CHF 216 040 | 10 292 | 0 | 10 292 | 0,08 |
| MYI | 01/2024 | CHF 43 | \$ 49 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 247 920 | CHF 216 416 | 9 347 | 0 | 9 347 | 0,07 |
| SCX | 01/2024 | 84 | 72 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 50 315 | 43 904 | 1 876 | 0 | 1 876 | 0,01 |
| | | | | \$ 28 902 | \$ (46) | \$ 28 856 | 0,22 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en GBP (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de distribution, E en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, E en USD (exposition au risque de change) de distribution et H Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 5 382 | AUD 8 124 | \$ 163 | \$ 0 | \$ 163 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | COP 2 967 380 | \$ 772 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN 1 112 | 301 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 22 100 | CNY 156 799 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 647 | £ 4 459 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 01/2024 | 36 782 | ¥ 5 427 905 | 1 743 | 0 | 1 743 | 0,01 |
| | 01/2024 | 1 384 | NZD 2 271 | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| | 01/2024 | 299 | PEN 1 112 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | 767 | COP 2 967 380 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 02/2024 | 301 | PEN 1 112 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 2 007 | \$ 2 198 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 68 149 | 473 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 596 | DKK 4 044 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | 20 567 | € 18 850 | 261 | 0 | 261 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 046 | £ 3 190 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 01/2024 | 9 779 | ¥ 1 439 232 | 436 | 0 | 436 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CNY 37 216 | 5 243 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR 2 428 | 529 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 695 | CHF 604 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 01/2024 | 153 | CNY 1 081 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| CBK | 01/2024 | \$ | 737 COP | 2 967 380 | \$ 29 | \$ 0 | \$ 29 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 519 ¥ | 75 415 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 522 MYR | 2 428 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 611 THB | 56 684 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD | 1 139 | \$ 769 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 1 984 | 1 487 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 1 788 | 2 265 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 43 239 | 2 551 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 476 AUD | 716 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 7 265 CNY | 51 499 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 587 € | 3 292 | 51 | (1) | 50 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 8 648 KRW | 11 144 114 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 102 NOK | 1 095 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 648 SEK | 6 742 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 2 539 MXN | 43 239 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 93 SGD | 123 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | DUB GLM | 01/2024 | CLP | 241 555 | \$ 274 | 0 | (3) | (3) |
| 01/2024 | | MYR | 12 270 | 2 640 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 01/2024 | | \$ | 17 766 CAD | 24 143 | 546 | 0 | 546 | 0,01 |
| 01/2024 | | | 3 409 CHF | 2 988 | 142 | 0 | 142 | 0,00 |
| 01/2024 | | | 21 571 CNY | 152 344 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| 01/2024 | | | 1 184 CZK | 26 206 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 01/2024 | | | 790 DKK | 5 357 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2024 | | | 478 HUF | 167 467 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2024 | | | 909 ILS | 3 389 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| 01/2024 | | | 2 642 MYR | 12 270 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| 01/2024 | | | 1 448 PLN | 5 790 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 02/2024 | | | 273 CLP | 241 555 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2024 | | | 2 647 MYR | 12 270 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 01/2024 | | | 11 SGD | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2024 | | € | 11 681 | \$ 12 823 | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| 01/2024 | | ¥ | 892 318 | 6 261 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| 01/2024 | | \$ | 2 977 AUD | 4 491 | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| 01/2024 | | | 2 796 CAD | 3 783 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| 01/2024 | | | 275 CLP | 241 555 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2024 | | 528 CNY | 3 740 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 01/2024 | | 633 ¥ | 90 536 | 9 | 0 | 9 | 0,00 | |
| 01/2024 | | 655 KRW | 849 670 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | | 2 508 MXN | 43 239 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 267 CAD | 1 671 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 154 247 € | 140 336 | 811 | 0 | 811 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 13 986 ¥ | 2 061 874 | 649 | 0 | 649 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 1 444 SGD | 1 926 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 453 IDR | 7 016 330 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | CNY | 6 637 | \$ 937 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | TWD | 3 920 | 126 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 22 515 CNY | 159 799 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 629 ¥ | 90 385 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 127 SEK | 22 093 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 8 690 | \$ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 843 IDR | 44 204 227 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 23 116 ¥ | 3 390 770 | 951 | 0 | 951 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 1 775 AUD | 2 675 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 0 CZK | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 21 931 £ | 17 330 | 161 | 0 | 161 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 459 NOK | 4 898 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | | | | | \$ 6 861 | \$ (404) | \$ 6 457 | 0,05 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, G Détail en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de capitalisation, T en EUR (couverte) de capitalisation, W en EUR (couverte) de capitalisation et W en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| BPS | 01/2024 | € | 30 967 \$ | 33 820 | \$ 0 | \$ (395) | (395) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 268 505 € | 1 152 383 | 4 772 | (5) | 4 767 | 0,04 |
| BRC | 01/2024 | | 1 263 641 | 1 148 995 | 5 887 | 0 | 5 887 | 0,04 |
| CBK | 01/2024 | € | 4 942 \$ | 5 448 | 8 | (19) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 4 087 € | 3 758 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € | 5 760 \$ | 6 254 | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 276 965 € | 1 168 080 | 13 651 | 0 | 13 651 | 0,10 |
| | | | | \$ 24 383 | \$ (529) | \$ 23 854 | 0,18 | |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de capitalisation, W en GBP (couverte) de capitalisation et W en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 302 | \$ 382 | \$ 0 | \$ (3) | \$ (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 20 861 | £ 16 462 | 125 | 0 | 125 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 23 898 | 18 841 | 122 | (1) | 121 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 410 | 325 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 480 | \$ 607 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 326 | £ 1 048 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 53 | 41 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 407 | \$ 518 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 991 | £ 7 906 | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 139 | \$ 175 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 37 | £ 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 136 191 | 107 671 | 1 073 | 0 | 1 073 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | 88 970 | 70 507 | 916 | 0 | 916 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | £ 804 | \$ 1 007 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 136 154 | £ 107 583 | 997 | 0 | 997 | 0,01 |
| | | | | \$ 3 334 | \$ (31) | \$ 3 303 | 0,03 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en NOK (couverte) de capitalisation, Investisseurs en NOK (couverte) de capitalisation et W en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 61 219 | NOK 650 913 | \$ 2 885 | \$ 0 | \$ 2 885 | 0,02 |
| BPS | 01/2024 | NOK 138 | \$ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 582 | NOK 5 987 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 68 281 | 730 632 | 3 673 | 0 | 3 673 | 0,03 |
| GLM | 01/2024 | NOK 50 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 510 | NOK 5 579 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | NOK 209 | \$ 19 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 212 | NOK 13 136 | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | NOK 1 446 | \$ 135 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 | NOK 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | NOK 314 | \$ 29 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 327 | NOK 25 359 | 170 | 0 | 170 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 99 094 | 1 055 907 | 4 894 | 0 | 4 894 | 0,04 |
| | | | | \$ 11 751 | \$ (11) | \$ 11 740 | 0,09 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NZD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 28 602 | NZD 46 943 | \$ 1 120 | \$ 0 | \$ 1 120 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | 26 967 | 43 856 | 801 | 0 | 801 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 28 752 | 46 736 | 840 | 0 | 840 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | 2 468 | 3 998 | 63 | 0 | 63 | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | NZD 84 | \$ 52 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 143 | 90 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 24 | NZD 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | 1 772 | 2 896 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| | | | | \$ 2 886 | \$ (1) | \$ 2 885 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | SEK 1 084 | \$ 104 | \$ 0 | \$ (4) | \$ (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 16 928 | SEK 176 568 | 596 | 0 | 596 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | SEK 1 002 | \$ 98 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 4 807 | 464 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 970 | SEK 20 557 | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SEK 2 904 | \$ 281 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 975 | 194 | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 402 | 39 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 18 313 | SEK 190 197 | 564 | 0 | 564 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | SEK 510 | \$ 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 18 470 | SEK 190 628 | 450 | 0 | 450 | 0,00 |
| | | | | \$ 1 681 | \$ (30) | \$ 1 651 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation, Institutions en SGD (couverte) de distribution, M Détail en SGD (couverte) de distribution II et W en SGD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| DUB | 01/2024 | \$ 66 534 | SGD 88 444 | \$ 534 | \$ 0 | \$ 534 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SGD 649 | \$ 484 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 026 | SGD 1 376 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | 14 323 | 19 102 | 162 | 0 | 162 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD 24 460 | \$ 18 299 | 0 | (249) | (249) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 784 | SGD 1 047 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 81 | \$ 61 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 685 | SGD 903 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 62 121 | 82 865 | 716 | 0 | 716 | 0,01 |
| | 02/2024 | 94 | 123 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | 58 914 | 78 607 | 694 | 0 | 694 | 0,01 |
| | | | | \$ 2 134 | \$ (258) | \$ 1 876 | 0,02 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ (43 598) | (0,33) |

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Fannie Mae, TBA 2,000 % éch. 01/02/2039 | \$ 95 000 | \$ (85 277) | (0,65) |
| Ginnie Mae, TBA 4,000 % éch. 01/02/2054 | 7 500 | (7 168) | (0,06) |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 2,000 % éch. 01/01/2039 | 104 400 | (93 618) | (0,72) |
| 2,000 % éch. 01/01/2054 | 210 150 | (171 798) | (1,31) |
| 2,000 % éch. 01/02/2054 | 449 000 | (367 478) | (2,81) |
| 3,000 % éch. 01/02/2054 | 37 800 | (33 478) | (0,26) |
| 3,000 % éch. 01/03/2054 | 43 000 | (38 131) | (0,29) |
| 5,500 % éch. 01/01/2054 (g) | 132 500 | (133 080) | (1,01) |
| Total des Titres vendus à découvert | \$ | (930 028) | (7,11) |
| Total des Investissements | \$ | 15 694 315 | 120,01 |
| Autres actifs et passifs à court terme | \$ | (2 617 053) | (20,01) |
| Actifs nets | \$ | 13 077 262 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

- * Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre à rémunération en nature.
- (c) Titre à coupon zéro.
- (d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (f) Affilié au Fonds.
- (g) Les titres vendus à découvert au 31 décembre 2023 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,40 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|-----------|--------------|---------------------|
| Citigroup, Inc. | 3,290 % | 17/03/2026 | 10/03/2022 | \$ 33 100 | \$ 32 241 | 0,25 |
| Deutsche Bank AG | 3,729 | 14/01/2032 | 21/01/2021 | 2 004 | 1 677 | 0,01 |
| | | | | \$ 35 104 | \$ 33 918 | 0,26 |

- (i) Des titres d'une juste valeur globale de 2 151 \$ (31 décembre 2022 : 1 610 \$) et un montant en numéraire de 323 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 394 447 \$ (31 décembre 2022 : 312 124 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 103 060 \$ (31 décembre 2022 : 142 980 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|----------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 14 901 954 | \$ 33 617 | \$ 14 935 571 |
| Fonds d'investissement | 875 438 | 435 751 | 0 | 1 311 189 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 371 917 | 0 | 371 917 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (50 364) | 56 030 | 0 | 5 666 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (930 028) | 0 | (930 028) |
| Totaux | \$ 825 074 | \$ 14 835 624 | \$ 33 617 | \$ 15 694 315 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|----------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 11 352 524 | \$ 8 573 | \$ 11 361 097 |
| Fonds d'investissement | 322 306 | 798 673 | 0 | 1 120 979 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 346 970 | 0 | 1 346 970 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 73 477 | (414 644) | 0 | (341 167) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (721 316) | 0 | (721 316) |
| Totaux | \$ 395 783 | \$ 12 362 207 | \$ 8 573 | \$ 12 766 563 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 3,500 % | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (295) | \$ (328) | 0,00 |
| JML | (1,000) | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (261) | (289) | 0,00 |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (617) | 0,00 |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (4 504) | \$ 5 510 | \$ 1 006 | \$ (1 118) | \$ 1 920 | \$ 802 |
| BOA | (10 306) | 9 930 | (376) | (61 601) | 51 870 | (9 731) |
| BPS | (14 522) | 19 830 | 5 308 | 2 102 | (1 850) | 252 |
| BRC | (61 368) | 56 470 | (4 898) | 1 917 | (1 260) | 657 |
| CBK | 10 530 | (12 210) | (1 680) | 57 544 | (56 500) | 1 044 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (438) | 0 | (438) |
| DUB | (1 810) | 1 710 | (100) | (789) | 220 | (569) |
| FAR | (358) | 0 | (358) | (224) | 0 | (224) |
| FBF | S/O | S/O | S/O | 40 | 0 | 40 |
| GLM | 5 715 | (7 530) | (1 815) | (7 627) | 6 700 | (927) |
| GST | (88) | 710 | 622 | (287) | 280 | (7) |
| HUS | S/O | S/O | S/O | (120) | 140 | 20 |
| IND | S/O | S/O | S/O | 2 835 | (2 760) | 75 |
| JPM | 392 | (910) | (518) | 3 194 | (3 600) | (406) |
| MBC | 35 995 | (42 350) | (6 355) | (13 437) | 11 460 | (1 977) |
| MYC | (1 021) | 1 360 | 339 | (35) | 350 | 315 |
| MYI | (3 178) | 1 180 | (1 998) | (9 902) | 7 130 | (2 772) |
| RBC | 6 | 0 | 6 | (363) | 320 | (43) |
| RYL | 8 | 0 | 8 | 2 | 0 | 2 |
| SCX | (6 224) | 6 360 | 136 | (36 806) | 34 940 | (1 866) |
| SOG | 19 | 0 | 19 | 394 | (300) | 94 |
| SSB | 926 | (800) | 126 | 2 274 | (1 930) | 344 |
| TOR | 1 353 | (1 250) | 103 | (12 186) | 12 810 | 624 |
| UAG | 4 837 | (4 470) | 367 | (15 867) | 14 840 | (1 027) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû/de la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 67,03 | 67,82 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 47,18 | 30,98 |
| Autres valeurs mobilières | 0,00 | 0,69 |
| Fonds d'investissement | 10,03 | 9,82 |
| Contrats de mise en pension | 2,84 | 11,79 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,55) | 0,62 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,92 | (2,82) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,33) | (0,79) |
| Titres vendus à découvert | (7,11) | (6,32) |
| Contrats de prise en pension | 0,00 | (0,01) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Australie | 1,56 | 1,53 |
| Autriche | S/O | 0,07 |
| Brésil | S/O | 0,00 |
| Canada | 1,31 | 0,68 |
| Îles Caïmans | 1,95 | 2,31 |
| Chine | 0,07 | 0,01 |
| République tchèque | 0,00 | 0,00 |
| Danemark | 2,02 | 2,36 |
| Finlande | 0,01 | 0,01 |
| France | 2,14 | 2,98 |
| Allemagne | 1,35 | 2,15 |
| Hong Kong | S/O | 0,25 |
| Hongrie | 0,18 | 0,04 |
| Internationales | 0,21 | S/O |
| Irlande | 4,97 | 5,70 |
| Israël | 1,20 | 0,46 |
| Italie | 1,01 | 1,23 |
| Japon | 7,62 | 6,06 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,08 | 0,08 |
| Luxembourg | 0,51 | 0,55 |
| Malaisie | 0,83 | 0,60 |
| Mexique | 0,06 | 0,12 |
| Multinationales | 0,08 | 0,10 |
| Pays-Bas | 0,59 | 1,10 |
| Nouvelle-Zélande | 0,14 | 0,21 |
| Norvège | 0,20 | 0,27 |
| Pérou | 0,14 | 0,52 |
| Pologne | 0,28 | 0,03 |
| Portugal | 0,02 | 0,01 |
| Qatar | 0,08 | 0,13 |
| Roumanie | 0,78 | 0,51 |
| Arabie saoudite | 0,68 | 0,14 |
| Serbie | S/O | 0,22 |
| Singapour | 0,14 | S/O |
| Slovénie | 0,18 | 0,19 |
| Afrique du Sud | S/O | 0,00 |
| Corée du Sud | 3,32 | 0,98 |
| Espagne | 0,70 | 0,96 |
| Supranationales | 0,08 | 0,20 |
| Suède | 0,00 | 0,00 |
| Suisse | 1,08 | 1,25 |
| Thaïlande | 0,23 | 0,29 |
| Émirats arabes unis | 0,06 | 0,07 |
| Royaume-Uni | 5,89 | 8,24 |
| États-Unis | 53,69 | 39,76 |
| Instruments à court terme | 18,77 | 17,12 |
| Fonds d'investissement | 10,03 | 9,82 |
| Contrats de mise en pension | 2,84 | 11,79 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,55) | 0,63 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,03) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,08) | (0,13) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,14 | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base | S/O | 0,01 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,86 | (2,67) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,05 | 0,05 |
| Options sur titres | 0,08 | 0,09 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Options de change | (0,01) | S/O |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,19) | (0,28) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,02) | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps sur devises croisées | 0,01 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | (0,01) |
| Contrats de change à terme | (0,89) | (1,70) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,63 | 1,07 |
| Titres vendus à découvert | (7,11) | (6,32) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (20,01) | (11,79) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------------|---|----------------------------------|------------------------------|-------------|-------------------------------------|---|------------------------------|---------|----------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETTS PRIVÉS | | | | | | | | | | | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | | | | | | | | | | | |
| AerCap Ireland Capital DAC 1,650 % éch. 29/10/2024 | \$ | 1 000 | \$ 966 | 0,03 | Doctors Co. An Interinsurance Exchange 4,500 % éch. 18/01/2032 | \$ | 600 | \$ 479 | 0,01 | Nykredit Realkredit A/S 0,375 % éch. 17/01/2028 | € | 1 400 | \$ 1 364 | 0,04 |
| AIB Group PLC 4,625 % éch. 23/07/2029 | € | 7 000 | 7 988 | 0,22 | EQT AB 2,375 % éch. 06/04/2028 | € | 5 000 | 5 226 | 0,15 | 1,000 % éch. 01/04/2024 | DKK | 160 400 | 23 625 | 0,66 |
| American Tower Corp. 5,250 % éch. 15/07/2028 | \$ | 5 000 | 5 083 | 0,14 | Eurofima Europäische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 3,125 % éch. 09/11/2031 | € | 8 000 | 9 149 | 0,26 | 1,000 % éch. 01/10/2050 | | 122 874 | 14 100 | 0,40 |
| Banque de développement asiatique 4,700 % éch. 12/03/2024 | MXN | 79 400 | 4 624 | 0,13 | Banque européenne d'investissement 2,650 % éch. 21/10/2032 | AUD | 5 000 | 3 036 | 0,09 | 1,000 % éch. 01/10/2053 | | 27 | 3 | 0,00 |
| Aviation Capital Group LLC 4,125 % éch. 01/08/2025 | \$ | 1 000 | 971 | 0,03 | 3,300 % éch. 03/02/2028 | | 1 000 | 661 | 0,02 | 1,500 % éch. 01/10/2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| Banco de Sabadell S.A. 1,125 % éch. 11/03/2027 | € | 2 700 | 2 833 | 0,08 | Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % éch. 15/03/2024 | \$ | 6 900 | 5 752 | 0,16 | 2,000 % éch. 01/10/2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| Banco Santander S.A. 1,849 % éch. 25/03/2026 | \$ | 400 | 370 | 0,01 | 4,452 % éch. 30/04/2024 | € | 3 200 | 3 536 | 0,10 | 2,500 % éch. 01/10/2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| Bank of America Corp. 2,687 % éch. 22/04/2032 | | 2 000 | 1 689 | 0,05 | 4,956 % éch. 07/02/2025 | | 5 200 | 5 750 | 0,16 | 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK | 80 600 | 11 944 | 0,34 |
| 4,916 % éch. 22/09/2026 | € | 8 000 | 8 878 | 0,25 | 6,484 % éch. 24/10/2029 | \$ | 5 000 | 5 309 | 0,15 | 1,500 % éch. 01/10/2053 | | 19 749 | 2 346 | 0,07 |
| 4,962 % éch. 24/08/2025 | | 1 700 | 1 887 | 0,05 | Hana Bank 3,750 % éch. 04/05/2026 | € | 16 200 | 18 112 | 0,51 | 2,000 % éch. 01/10/2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 5,015 % éch. 22/07/2033 | \$ | 6 000 | 5 938 | 0,17 | HAT Holdings LLC 3,375 % éch. 15/06/2026 | \$ | 10 940 | 10 289 | 0,29 | Royal Bank of Canada 0,010 % éch. 05/10/2028 | € | 5 600 | 5 409 | 0,15 |
| 5,288 % éch. 25/04/2034 | | 2 900 | 2 908 | 0,08 | HSBC Holdings PLC 2,804 % éch. 24/05/2032 | | 10 000 | 8 353 | 0,23 | Santander UK Group Holdings PLC 3,530 % éch. 25/08/2028 | | 6 100 | 6 696 | 0,19 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 5,896 % éch. 13/07/2026 | | 7 700 | 7 866 | 0,22 | 2,999 % éch. 10/03/2026 | | 300 | 291 | 0,01 | 3,625 % éch. 14/01/2026 | £ | 300 | 370 | 0,01 |
| Barclays PLC 2,667 % éch. 10/03/2032 | | 6 100 | 5 035 | 0,14 | 3,973 % éch. 22/05/2030 | | 200 | 187 | 0,01 | 3,823 % éch. 03/11/2028 | £ | 300 | 282 | 0,01 |
| 3,125 % éch. 17/01/2024 | £ | 1 200 | 1 528 | 0,04 | 4,300 % éch. 08/03/2026 | | 1 600 | 1 574 | 0,04 | 7,482 % éch. 29/08/2029 | £ | 9 000 | 12 487 | 0,35 |
| 4,375 % éch. 12/01/2026 | \$ | 2 900 | 2 861 | 0,08 | 6,254 % éch. 09/03/2034 | | 11 200 | 11 910 | 0,33 | Santander UK PLC 5,770 % éch. 12/02/2027 | | 700 | 894 | 0,02 |
| 4,918 % éch. 08/08/2030 | € | 3 300 | 3 801 | 0,11 | IHG Finance LLC 4,375 % éch. 28/11/2029 | € | 6 400 | 7 336 | 0,21 | Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % éch. 22/06/2026 | € | 3 300 | 3 297 | 0,09 |
| 6,224 % éch. 09/05/2034 | \$ | 10 900 | 11 311 | 0,32 | ING Groep NV 2,125 % éch. 23/05/2026 | | 8 200 | 8 866 | 0,25 | Société Générale S.A. 1,488 % éch. 14/12/2026 | \$ | 4 400 | 4 053 | 0,11 |
| 6,692 % éch. 13/09/2034 | | 8 000 | 8 558 | 0,24 | Banque interaméricaine de développement 2,500 % éch. 14/04/2027 | AUD | 600 | 389 | 0,01 | 2,226 % éch. 21/01/2026 | | 4 500 | 4 324 | 0,12 |
| BlueHub Loan Fund, Inc. 2,890 % éch. 01/01/2027 | | 900 | 803 | 0,02 | Intesa Sanpaolo SpA 4,000 % éch. 23/09/2029 | \$ | 5 568 | 5 073 | 0,14 | 6,691 % éch. 10/01/2034 | | 12 000 | 12 685 | 0,36 |
| 3,099 % éch. 01/01/2030 | | 1 900 | 1 579 | 0,04 | JAB Holdings BV 5,000 % éch. 12/06/2033 | € | 6 600 | 7 874 | 0,22 | Standard Chartered PLC 2,678 % éch. 29/06/2032 | | 6 100 | 4 965 | 0,14 |
| BNP Paribas S.A. 2,219 % éch. 09/06/2026 | | 3 600 | 3 438 | 0,10 | JPMorgan Chase & Co. 2,595 % éch. 24/02/2026 | \$ | 3 900 | 3 779 | 0,11 | Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,010 % éch. 10/09/2025 | € | 3 900 | 4 071 | 0,11 |
| 4,375 % éch. 13/01/2029 | € | 6 500 | 7 443 | 0,21 | 4,565 % éch. 14/06/2030 | | 5 100 | 4 994 | 0,14 | 0,409 % éch. 07/11/2029 | | 1 300 | 1 227 | 0,03 |
| BPCE S.A. 5,748 % éch. 19/07/2033 | \$ | 6 100 | 6 131 | 0,17 | 4,912 % éch. 25/07/2033 | | 3 700 | 3 660 | 0,10 | 2,440 % éch. 18/06/2024 | \$ | 1 000 | 985 | 0,03 |
| Brookfield Finance, Inc. 2,724 % éch. 15/04/2031 | | 3 350 | 2 832 | 0,08 | 5,350 % éch. 01/06/2034 | | 10 600 | 10 757 | 0,30 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % éch. 15/10/2027 | € | 2 500 | 2 460 | 0,07 |
| Caja Rural de Navarra SCC 0,875 % éch. 08/05/2025 | € | 2 000 | 2 138 | 0,06 | Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/04/2024 | DKK | 45 900 | 6 762 | 0,19 | Toronto-Dominion Bank 5,920 % éch. 12/06/2028 | £ | 6 200 | 7 901 | 0,22 |
| CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,900 % éch. 12/10/2029 | | 6 000 | 5 521 | 0,15 | 1,000 % éch. 01/10/2050 | | 10 589 | 1 168 | 0,03 | UBS Group AG 2,593 % éch. 11/09/2025 | \$ | 2 080 | 2 035 | 0,06 |
| Community Preservation Corp. 2,867 % éch. 01/02/2030 | \$ | 3 300 | 2 893 | 0,08 | 1,500 % éch. 01/07/2050 | | 0 | 0 | 0,00 | 2,875 % éch. 02/04/2032 | € | 8 100 | 8 376 | 0,23 |
| Cooperatieve Rabobank UA 3,758 % éch. 06/04/2033 | | 1 600 | 1 437 | 0,04 | 1,500 % éch. 01/10/2050 | | 0 | 0 | 0,00 | 3,750 % éch. 26/03/2025 | \$ | 250 | 245 | 0,01 |
| Coventry Building Society 0,010 % éch. 07/07/2028 | € | 600 | 583 | 0,02 | 2,000 % éch. 01/10/2047 | | 0 | 0 | 0,00 | 3,869 % éch. 12/01/2029 | | 2 000 | 1 887 | 0,05 |
| CPI Property Group S.A. 1,500 % éch. 27/01/2031 | | 2 700 | 1 578 | 0,04 | Kookmin Bank 0,052 % éch. 15/07/2025 | € | 2 100 | 2 206 | 0,06 | 4,194 % éch. 01/04/2031 | | 1 800 | 1 678 | 0,05 |
| 1,625 % éch. 23/04/2027 | | 1 200 | 977 | 0,03 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,250 % éch. 24/03/2031 | | 6 100 | 7 090 | 0,20 | 4,550 % éch. 17/04/2026 | | 1 950 | 1 925 | 0,05 |
| 1,750 % éch. 14/01/2030 | | 5 200 | 3 283 | 0,09 | Lloyds Banking Group PLC 3,900 % éch. 12/03/2024 | \$ | 500 | 498 | 0,01 | 4,965 % éch. 16/01/2026 | € | 340 | 376 | 0,01 |
| 2,750 % éch. 22/01/2028 | £ | 1 000 | 898 | 0,03 | Logicor Financing SARL 0,625 % éch. 17/11/2025 | € | 3 500 | 3 609 | 0,10 | 6,246 % éch. 22/09/2029 | \$ | 500 | 522 | 0,01 |
| Credit Suisse AG 0,250 % éch. 05/01/2026 | € | 900 | 934 | 0,03 | Low Income Investment Fund 3,386 % éch. 01/07/2026 | \$ | 750 | 708 | 0,02 | 6,442 % éch. 11/08/2028 | | 2 650 | 2 754 | 0,08 |
| 3,625 % éch. 09/09/2024 | \$ | 3 800 | 3 748 | 0,11 | 3,711 % éch. 01/07/2029 | | 1 950 | 1 749 | 0,05 | 6,537 % éch. 12/08/2033 | | 4 500 | 4 805 | 0,13 |
| 7,500 % éch. 15/02/2028 | | 4 100 | 4 493 | 0,13 | MDGH GMTN RSC Ltd. 5,500 % éch. 28/04/2033 | | 1 400 | 1 487 | 0,04 | 7,750 % éch. 01/03/2029 | € | 2 100 | 2 677 | 0,08 |
| CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025 | € | 3 100 | 3 229 | 0,09 | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,978 % éch. 09/06/2024 | € | 2 200 | 2 399 | 0,07 | 9,016 % éch. 15/11/2033 | \$ | 5 700 | 7 011 | 0,20 |
| 0,625 % éch. 27/09/2026 | | 1 200 | 1 194 | 0,03 | Mizuho Financial Group, Inc. 0,956 % éch. 16/10/2024 | | 4 200 | 4 538 | 0,13 | UniCredit SpA 3,127 % éch. 03/06/2032 | | 4 700 | 3 976 | 0,11 |
| 0,875 % éch. 20/01/2026 | | 1 300 | 1 333 | 0,04 | Nationwide Building Society 4,302 % éch. 08/03/2029 | | 300 | 288 | 0,01 | Workspace Group PLC 2,250 % éch. 11/03/2028 | £ | 2 300 | 2 518 | 0,07 |
| 1,500 % éch. 27/09/2031 | | 1 100 | 949 | 0,03 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/04/2024 | DKK | 102 700 | 15 123 | 0,42 | | | 609 365 | 17,11 | |
| Deutsche Bank AG 0,050 % éch. 20/11/2024 | | 3 300 | 3 533 | 0,10 | 1,000 % éch. 01/10/2050 | | 31 510 | 3 490 | 0,10 | INDUSTRIE | | | | |
| 1,375 % éch. 17/02/2032 | | 1 800 | 1 637 | 0,05 | 1,500 % éch. 01/10/2050 | | 0 | 0 | 0,00 | Broadcom, Inc. 2,450 % éch. 15/02/2031 | \$ | 1 600 | 1 369 | 0,04 |
| 1,750 % éch. 19/11/2030 | | 2 800 | 2 693 | 0,08 | 1,500 % éch. 01/10/2053 | | 44 290 | 5 062 | 0,14 | 3,419 % éch. 15/04/2033 | | 800 | 703 | 0,02 |
| 1,875 % éch. 23/02/2028 | | 4 100 | 4 261 | 0,12 | 2,000 % éch. 01/10/2047 | | 0 | 0 | 0,00 | Continental Wind LLC 6,000 % éch. 28/02/2033 | | 1 604 | 1 637 | 0,05 |
| 2,625 % éch. 16/12/2024 | £ | 600 | 742 | 0,02 | 2,500 % éch. 01/10/2047 | | 0 | 0 | 0,00 | Dell International LLC 6,200 % éch. 15/07/2030 | | 2 500 | 2 684 | 0,08 |
| 3,961 % éch. 26/11/2025 | \$ | 24 200 | 23 809 | 0,67 | | | | | | Ford Motor Co. 3,250 % éch. 12/02/2032 | | 3 900 | 3 245 | 0,09 |
| 4,100 % éch. 13/01/2026 | | 4 200 | 4 086 | 0,11 | | | | | | Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. 5,000 % éch. 27/07/2028 | | 6 500 | 6 563 | 0,18 |
| DNB Boligkredit A/S 0,625 % éch. 19/06/2025 | € | 1 600 | 1 705 | 0,05 | | | | | | Oracle Corp. 4,500 % éch. 06/05/2028 | | 10 100 | 10 106 | 0,28 |
| | | | | | | | | | | 4,900 % éch. 06/02/2033 | | 7 900 | 7 868 | 0,22 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-----|-----|------|
| T-Mobile USA, Inc. 5,050 % éch. 15/07/2033 | \$ 7 600 | \$ 7 662 | 0,22 | 2,500 % éch. 15/01/2029 | \$ 4 227 | \$ 4 372 | 0,12 | JPMorgan Alternative Loan Trust 5,950 % éch. 25/10/2036 | \$ 219 | \$ 195 | 0,01 | | | |
| | | 41 837 | 1,18 | 3,875 % éch. 15/04/2029 | 749 | 826 | 0,03 | JPMorgan Mortgage Trust 5,652 % éch. 25/08/2035 | 96 | 93 | 0,00 | | | |
| SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | Billets du Trésor américain | | | | 6,000 % éch. 25/06/2037 | | | | 762 | 313 | 0,01 |
| AES Corp. 5,450 % éch. 01/06/2028 | 11 700 | 11 902 | 0,33 | 0,375 % éch. 30/09/2027 | 2 900 | 2 544 | 0,07 | Lehman XS Trust 6,512 % éch. 25/03/2047 | 420 | 360 | 0,01 | | | |
| Électricité de France S.A. 6,250 % éch. 23/05/2033 | 4 000 | 4 333 | 0,12 | 0,625 % éch. 30/11/2027 | 12 800 | 11 284 | 0,32 | Ludgate Funding PLC 5,574 % éch. 01/01/2061 | £ 1 766 | 2 175 | 0,06 | | | |
| 6,900 % éch. 23/05/2053 | 3 000 | 3 399 | 0,10 | 0,750 % éch. 31/01/2028 | 11 700 | 10 317 | 0,29 | 6,014 % éch. 01/01/2061 | 2 040 | 2 513 | 0,07 | | | |
| National Grid PLC 5,809 % éch. 12/06/2033 | 3 800 | 3 996 | 0,11 | 2,875 % éch. 30/04/2025 | 4 200 | 4 109 | 0,11 | Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust 3,489 % éch. 25/10/2047 | \$ 10 384 | 3 263 | 0,09 | | | |
| New York State Electric & Gas Corp. 5,650 % éch. 15/08/2028 | 4 000 | 4 105 | 0,12 | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON EMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | Miravet SARL 4,806 % éch. 26/05/2065 | € 1 226 | 1 343 | 0,04 | | | |
| Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % éch. 01/04/2053 | 8 000 | 8 703 | 0,24 | American Home Mortgage Investment Trust 7,430 % éch. 25/09/2035 | 167 | 71 | 0,00 | Mortimer BTL PLC 5,920 % éch. 23/06/2053 | £ 2 012 | 2 550 | 0,07 | | | |
| Southern Power Co. 0,900 % éch. 15/01/2026 | 6 000 | 5 530 | 0,16 | Atlas Funding PLC 6,120 % éch. 25/07/2058 | £ 1 646 | 2 100 | 0,06 | New Residential Mortgage Loan Trust 3,500 % éch. 25/12/2057 | \$ 870 | 832 | 0,02 | | | |
| Verizon Communications, Inc. 5,050 % éch. 09/05/2033 | 5 400 | 5 512 | 0,15 | Atrium Hotel Portfolio Trust 6,589 % éch. 15/12/2036 | \$ 4 844 | 4 609 | 0,13 | Paragon Mortgages PLC 6,270 % éch. 15/05/2045 | £ 70 | 90 | 0,00 | | | |
| | | 47 480 | 1,33 | Bear Stearns ALT-A Trust 4,492 % éch. 25/11/2036 | 597 | 311 | 0,01 | Polaris PLC 5,985 % éch. 23/12/2058 | 1 448 | 1 842 | 0,05 | | | |
| Total Obligations et billets privés | | 698 682 | 19,62 | Bear Stearns Mortgage Funding Trust 5,810 % éch. 25/06/2047 | 928 | 784 | 0,02 | Residential Accredited Loans, Inc. Trust 5,770 % éch. 25/06/2037 | \$ 258 | 239 | 0,01 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX | | | | Brass PLC 5,940 % éch. 16/11/2066 | £ 248 | 317 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/06/2036 | 344 | 265 | 0,01 | | | |
| Obligations California State General Obligation Bonds, Series 2033 | | 3 643 | 0,10 | Canada Square Funding PLC 6,000 % éch. 17/06/2058 | 1 618 | 2 053 | 0,06 | 6,288 % éch. 25/11/2037 | 234 | 192 | 0,01 | | | |
| 5,125 % éch. 01/03/2038 | 3 600 | | | 6,170 % éch. 17/06/2058 | 2 944 | 3 749 | 0,10 | Residential Mortgage Securities PLC 6,470 % éch. 20/06/2070 | £ 1 070 | 1 367 | 0,04 | | | |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | 6,470 % éch. 17/12/2057 | 1 340 | 1 714 | 0,05 | RESIMAC Bastille Trust 6,390 % éch. 05/09/2057 | \$ 32 | 32 | 0,00 | | | |
| Fannie Mae 3,000 % éch. 01/03/2060 | 1 007 | 887 | 0,02 | Charter Mortgage Funding PLC 5,796 % éch. 16/01/2057 | 431 | 550 | 0,02 | RESIMAC Premier 6,524 % éch. 07/02/2052 | 397 | 397 | 0,01 | | | |
| 3,500 % éch. 01/01/2059 | 617 | 560 | 0,02 | Chase Mortgage Finance Trust 4,523 % éch. 25/07/2037 | \$ 7 | 5 | 0,00 | Ripon Mortgages PLC 5,920 % éch. 28/08/2056 | £ 12 378 | 15 733 | 0,44 | | | |
| Freddie Mac 3,500 % éch. 01/05/2048 | 5 140 | 4 806 | 0,14 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 3,209 % éch. 10/05/2049 | 2 100 | 1 988 | 0,06 | RMAC PLC 0,000 % éch. 15/02/2047 | 12 767 | 16 328 | 0,46 | | | |
| 4,000 % éch. 01/06/2048 | 3 740 | 3 613 | 0,10 | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 4,907 % éch. 25/12/2035 | 327 | 217 | 0,01 | RMAC Securities PLC 5,509 % éch. 12/06/2044 | 32 | 39 | 0,00 | | | |
| Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/07/2046 | | 19 | 0,00 | Commercial Mortgage Trust 3,590 % éch. 10/11/2047 | 2 000 | 1 958 | 0,05 | Sequoia Mortgage Trust 3,917 % éch. 20/07/2037 | \$ 184 | 136 | 0,00 | | | |
| - 20/05/2047 | 20 | | | 3,611 % éch. 10/08/2049 | 1 000 | 929 | 0,03 | Stratton Mortgage Funding PLC 6,069 % éch. 25/09/2051 | £ 2 332 | 2 972 | 0,08 | | | |
| 4,500 % éch. 20/06/2053 | 199 | 194 | 0,01 | 4,228 % éch. 10/05/2051 | 1 700 | 1 598 | 0,04 | 6,120 % éch. 12/03/2052 | 1 832 | 2 336 | 0,07 | | | |
| 6,464 % éch. 20/04/2067 | 185 | 185 | 0,01 | Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % éch. 25/11/2034 | 106 | 103 | 0,00 | 6,121 % éch. 20/07/2060 | 2 703 | 3 445 | 0,10 | | | |
| Ginnie Mae, TBA 3,000 % éch. 01/02/2054 | 20 800 | 18 848 | 0,53 | 5,710 % éch. 25/06/2036 | 70 | 62 | 0,00 | Structured Asset Securities Corp. 5,750 % éch. 25/01/2036 | \$ 135 | 112 | 0,00 | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | | 5,890 % éch. 25/07/2046 | 412 | 335 | 0,01 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,760 % éch. 25/10/2036 | 278 | 224 | 0,01 | | | |
| 2,500 % éch. 01/12/2051 | 46 409 | 39 519 | 1,11 | 5,950 % éch. 25/08/2047 | 727 | 637 | 0,02 | TBW Mortgage-Backed Trust 5,965 % éch. 25/07/2037 | 2 296 | 706 | 0,02 | | | |
| - 01/03/2052 | 8 069 | 7 144 | 0,20 | 6,250 % éch. 25/12/2036 | 1 033 | 454 | 0,01 | Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | £ 542 | 691 | 0,02 | | | |
| 3,000 % éch. 01/07/2052 | 8 069 | 7 144 | 0,20 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 6,000 % éch. 25/07/2036 | 246 | 129 | 0,00 | 6,571 % éch. 20/07/2045 | 937 | 1 197 | 0,03 | | | |
| 3,500 % éch. 01/03/2047 | 28 356 | 26 093 | 0,73 | 6,000 % éch. 25/12/2036 | 602 | 246 | 0,01 | Trinity Square PLC 6,070 % éch. 15/07/2059 | 1 527 | 1 947 | 0,05 | | | |
| - 01/04/2053 | 147 912 | 139 968 | 3,93 | 6,000 % éch. 25/03/2037 | 598 | 290 | 0,01 | Twin Bridges PLC 6,070 % éch. 12/03/2055 | 2 483 | 3 154 | 0,09 | | | |
| 4,000 % éch. 01/07/2048 | 161 958 | 157 108 | 4,41 | 6,010 % éch. 25/04/2046 | 1 851 | 537 | 0,01 | Uropa Securities PLC 5,690 % éch. 10/10/2040 | 258 | 299 | 0,01 | | | |
| - 01/07/2053 | 144 365 | 142 914 | 4,01 | 6,050 % éch. 25/03/2035 | 311 | 256 | 0,01 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,858 % éch. 25/02/2037 | \$ 2 628 | 2 293 | 0,06 | | | |
| 5,000 % éch. 01/02/2053 | 93 478 | 93 902 | 2,64 | 6,150 % éch. 25/03/2035 | 67 | 59 | 0,00 | 4,172 % éch. 25/09/2036 | 57 | 48 | 0,00 | | | |
| 5,500 % éch. 01/02/2053 | 39 416 | 40 048 | 1,12 | 6,500 % éch. 25/11/2047 | 92 | 47 | 0,00 | 4,615 % éch. 25/10/2035 | 77 | 69 | 0,00 | | | |
| 6,000 % éch. 01/01/2053 | | | | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 5,770 % éch. 25/09/2047 | 697 | 593 | 0,02 | 5,662 % éch. 25/09/2033 | 39 | 36 | 0,00 | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | 6,030 % éch. 25/08/2036 | 3 835 | 3 451 | 0,10 | 6,012 % éch. 25/02/2046 | 249 | 218 | 0,01 | | | |
| 2,500 % éch. 01/01/2054 | 13 000 | 11 061 | 0,31 | Dutch Property Finance BV 4,602 % éch. 28/07/2058 | € 2 139 | 2 358 | 0,07 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,500 % éch. 25/04/2035 | 286 | 231 | 0,01 | | | |
| 5,000 % éch. 01/01/2054 | 62 700 | 62 048 | 1,74 | EMF-UK PLC 6,319 % éch. 13/03/2046 | £ 177 | 224 | 0,01 | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 01/01/2054 | 70 100 | 70 417 | 1,98 | Eurohome UK Mortgages PLC 5,490 % éch. 15/06/2044 | 18 | 23 | 0,00 | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 01/02/2054 | 129 800 | 131 803 | 3,70 | EuroMASTR PLC 5,531 % éch. 15/06/2040 | 43 | 52 | 0,00 | | | | | | | |
| 6,500 % éch. 01/02/2054 | 319 700 | 327 605 | 9,20 | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 6,250 % éch. 25/11/2036 | \$ 32 | 10 | 0,00 | | | | | | | |
| | | 1 278 742 | 35,91 | Genesis Mortgage Funding PLC 6,420 % éch. 15/09/2059 | £ 6 181 | 7 906 | 0,22 | | | | | | | |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | GSR Mortgage Loan Trust 4,489 % éch. 25/11/2035 | \$ 46 | 45 | 0,00 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | | | |
| Obligations du Trésor américain | | | | 5,349 % éch. 25/10/2035 | 21 | 20 | 0,00 | Accunia European CLO DAC 4,915 % éch. 15/07/2030 | € 304 | 336 | 0,01 | | | |
| 1,625 % éch. 15/11/2050 | 10 100 | 6 020 | 0,17 | Impac Secured Assets Trust 5,990 % éch. 25/01/2037 | 436 | 360 | 0,01 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,370 % éch. 25/12/2034 | \$ 101 | 91 | 0,00 | | | |
| 1,875 % éch. 15/02/2041 | 42 500 | 30 578 | 0,86 | IndyMac Mortgage Loan Trust 4,699 % éch. 25/12/2034 | 115 | 109 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/08/2035 | 1 331 | 1 290 | 0,04 | | | |
| 2,875 % éch. 15/05/2052 | 6 900 | 5 496 | 0,16 | 5,810 % éch. 25/11/2036 | 2 332 | 2 298 | 0,06 | | | | | | | |
| 4,000 % éch. 15/11/2052 | 5 200 | 5 132 | 0,14 | | | | | | | | | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c) | | | | | | | | | | | | | | |
| 0,125 % éch. 15/10/2024 | 3 837 | 3 754 | 0,11 | | | | | | | | | | | |
| 0,125 % éch. 15/04/2025 | 25 133 | 24 238 | 0,68 | | | | | | | | | | | |
| 0,125 % éch. 15/07/2031 | 21 696 | 19 300 | 0,54 | | | | | | | | | | | |
| 0,125 % éch. 15/01/2032 | 28 081 | 24 679 | 0,69 | | | | | | | | | | | |
| 0,250 % éch. 15/01/2025 | 32 215 | 31 272 | 0,88 | | | | | | | | | | | |
| 0,500 % éch. 15/01/2028 | 10 602 | 10 036 | 0,28 | | | | | | | | | | | |
| 0,625 % éch. 15/07/2032 | 1 588 | 1 452 | 0,04 | | | | | | | | | | | |
| 1,125 % éch. 15/01/2033 | 35 222 | 33 345 | 0,94 | | | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Adagio CLO DAC | | | | 4,673 % éch. 20/10/2031 | 1 181 | \$ 1 285 | 0,04 | Saxon Asset Securities Trust | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 2 400 | \$ 2 615 | 0,07 | 4,725 % éch. 15/07/2031 | 3 300 | 3 593 | 0,10 | 2,011 % éch. 25/05/2035 | \$ 2 780 | \$ 2 606 | 0,07 |
| Apidos CLO | | | | 4,815 % éch. 15/01/2032 | 4 700 | 5 126 | 0,14 | Sculptor European CLO DAC | | | |
| 6,687 % éch. 20/04/2031 | \$ 5 581 | 5 581 | 0,16 | Home Equity Asset Trust | | | | 4,755 % éch. 14/01/2032 | € 4 900 | 5 335 | 0,15 |
| Aqueduct European CLO DAC | | | | 6,145 % éch. 25/02/2036 | \$ 738 | 713 | 0,02 | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | |
| 4,633 % éch. 20/07/2030 | € 1 969 | 2 159 | 0,06 | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | | 6,190 % éch. 25/10/2035 | \$ 5 600 | 4 626 | 0,13 |
| Ares CLO Ltd. | | | | 5,690 % éch. 25/04/2037 | 247 | 187 | 0,01 | Segovia European CLO DAC | | | |
| 6,825 % éch. 15/10/2030 | \$ 3 996 | 4 000 | 0,11 | 7,420 % éch. 25/03/2035 | 1 295 | 1 178 | 0,03 | 4,873 % éch. 20/07/2032 | € 2 700 | 2 945 | 0,08 |
| Ares European CLO DAC | | | | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | | Soundview Home Loan Trust | | | |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | € 2 665 | 2 916 | 0,08 | 4,713 % éch. 25/01/2037 | 1 435 | 1 084 | 0,03 | 5,875 % éch. 25/12/2036 | \$ 1 300 | 1 268 | 0,04 |
| 4,843 % éch. 20/04/2032 | 4 100 | 4 458 | 0,13 | IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | | 5,970 % éch. 25/11/2036 | 898 | 846 | 0,02 |
| Argent Securities Trust | | | | 4,652 % éch. 25/03/2035 | 1 611 | 1 571 | 0,04 | Steele Creek CLO Ltd. | | | |
| 5,830 % éch. 25/04/2036 | \$ 4 991 | 1 621 | 0,05 | KKR CLO Ltd. | | | | 6,905 % éch. 15/10/2030 | 5 060 | 5 058 | 0,14 |
| Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | | 6,835 % éch. 15/01/2031 | 2 608 | 2 608 | 0,07 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,805 % éch. 16/01/2030 | 1 777 | 1 774 | 0,05 | Laurelin DAC | | | | 5,995 % éch. 25/07/2036 | 1 073 | 1 023 | 0,03 |
| Aurium CLO DAC | | | | 4,713 % éch. 20/10/2031 | € 1 425 | 1 559 | 0,04 | Terwin Mortgage Trust | | | |
| 4,695 % éch. 16/01/2031 | € 4 789 | 5 233 | 0,15 | LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd. | | | | 6,410 % éch. 25/11/2033 | 4 | 4 | 0,00 |
| Bain Capital Euro CLO DAC | | | | 6,735 % éch. 16/07/2031 | \$ 4 264 | 4 264 | 0,12 | TIAA CLO Ltd. | | | |
| 4,733 % éch. 20/01/2032 | 1 967 | 2 147 | 0,06 | Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | 6,877 % éch. 20/07/2031 | 2 436 | 2 436 | 0,07 |
| Bayview Financial Asset Trust | | | | 6,070 % éch. 25/01/2036 | 673 | 586 | 0,02 | Toro European CLO DAC | | | |
| 6,970 % éch. 25/03/2037 | \$ 93 | 95 | 0,00 | LT Autorahoitus DAC | | | | 4,812 % éch. 15/02/2034 | € 5 000 | 5 448 | 0,15 |
| Benefit Street Partners CLO Ltd. | | | | 4,534 % éch. 18/07/2033 | € 5 545 | 6 144 | 0,17 | 4,885 % éch. 15/07/2030 | 115 | 128 | 0,00 |
| 6,777 % éch. 20/01/2031 | 2 197 | 2 199 | 0,06 | Madison Park Euro Funding DAC | | | | Trinitas CLO Ltd. | | | |
| Black Diamond CLO DAC | | | | 4,715 % éch. 15/01/2032 | 3 200 | 3 483 | 0,10 | 6,777 % éch. 20/07/2031 | \$ 2 528 | 2 529 | 0,07 |
| 4,982 % éch. 15/05/2032 | € 4 592 | 5 009 | 0,14 | 4,765 % éch. 15/07/2032 | 5 200 | 5 666 | 0,16 | Venture CLO Ltd. | | | |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | | Madison Park Funding Ltd. | | | | 6,535 % éch. 15/04/2027 | 56 | 56 | 0,00 |
| 4,685 % éch. 15/01/2031 | 1 987 | 2 170 | 0,06 | 0,000 % éch. 29/07/2030 | \$ 1 929 | 1 929 | 0,05 | 6,777 % éch. 20/01/2029 | 1 736 | 1 737 | 0,05 |
| 4,875 % éch. 15/01/2033 | 2 850 | 3 101 | 0,09 | Man GLG Euro CLO DAC | | | | 6,915 % éch. 15/01/2032 | 3 000 | 2 994 | 0,08 |
| BNPP AM Euro CLO DAC | | | | 4,775 % éch. 15/10/2032 | € 4 965 | 5 418 | 0,15 | Voya CLO Ltd. | | | |
| 4,822 % éch. 22/07/2032 | 4 800 | 5 234 | 0,15 | MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | | 6,805 % éch. 15/10/2031 | 11 100 | 11 085 | 0,31 |
| Bridgepoint CLO DAC | | | | 5,790 % éch. 25/08/2036 | \$ 12 198 | 4 514 | 0,13 | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 5,175 % éch. 15/01/2034 | 3 400 | 3 729 | 0,11 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | 5,815 % éch. 25/01/2037 | 2 475 | 2 389 | 0,07 |
| Cairn CLO BV | | | | 5,710 % éch. 25/02/2037 | 622 | 187 | 0,01 | Wind River CLO Ltd. | | | |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | 1 299 | 1 412 | 0,04 | 6,190 % éch. 25/05/2036 | 166 | 163 | 0,01 | 6,707 % éch. 18/07/2031 | 905 | 905 | 0,03 |
| Carlyle Euro CLO DAC | | | | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | | | | |
| 4,665 % éch. 15/01/2031 | 2 182 | 2 386 | 0,07 | 5,540 % éch. 25/10/2036 | 794 | 343 | 0,01 | | | | |
| 4,892 % éch. 15/08/2032 | 3 000 | 3 270 | 0,09 | 5,570 % éch. 25/11/2036 | 5 681 | 2 649 | 0,08 | | | | |
| Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. | | | | 5,720 % éch. 25/07/2036 | 59 | 52 | 0,00 | | | | |
| 6,634 % éch. 17/04/2031 | \$ 3 141 | 3 139 | 0,09 | 6,070 % éch. 25/12/2034 | 478 | 430 | 0,01 | Adif Alta Velocidad | | | |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | | 6,145 % éch. 25/09/2035 | 3 148 | 2 951 | 0,08 | 0,550 % éch. 31/10/2031 | € 5 000 | 4 513 | 0,13 |
| 4,752 % éch. 15/11/2031 | € 1 497 | 1 631 | 0,05 | 6,430 % éch. 25/09/2034 | 650 | 643 | 0,02 | Auckland Council | | | |
| Carlyle U.S. CLO Ltd. | | | | Morgan Stanley Structured Trust | | | | 0,250 % éch. 17/11/2031 | 5 000 | 4 537 | 0,13 |
| 6,835 % éch. 15/01/2030 | \$ 3 171 | 3 171 | 0,09 | 5,770 % éch. 25/06/2037 | 2 720 | 2 485 | 0,07 | Obligation internationale du gouvernement australien | | | |
| Catamaran CLO Ltd. | | | | Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. | | | | 0,500 % éch. | | | |
| 6,774 % éch. 22/04/2030 | 2 903 | 2 903 | 0,08 | 6,717 % éch. 20/04/2031 | 2 500 | 2 498 | 0,07 | 21/09/2026 | AUD 5 800 | 3 642 | 0,10 |
| Cedar Funding CLO Ltd. | | | | New Century Home Equity Loan Trust | | | | 1,000 % éch. 21/12/2030 | 2 600 | 1 472 | 0,04 |
| 6,764 % éch. 17/07/2031 | 4 400 | 4 400 | 0,12 | 6,235 % éch. 25/02/2035 | 2 343 | 2 264 | 0,06 | 1,250 % éch. 21/05/2032 | 1 200 | 665 | 0,02 |
| CIFC Funding Ltd. | | | | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | | | | 1,750 % éch. 21/06/2051 | 1 400 | 565 | 0,02 |
| 6,640 % éch. 24/04/2031 | 2 965 | 2 965 | 0,08 | 6,100 % éch. 25/02/2036 | 3 934 | 3 533 | 0,10 | 4,500 % éch. 21/04/2033 | 6 000 | 4 271 | 0,12 |
| 6,709 % éch. 27/04/2031 | 2 282 | 2 281 | 0,06 | Northwoods Capital Ltd. | | | | Communauté autonome d'Andalousie | | | |
| 6,844 % éch. 16/11/2030 | 4 179 | 4 182 | 0,12 | 6,758 % éch. 19/04/2031 | 4 567 | 4 572 | 0,13 | 0,500 % éch. 30/04/2031 | € 4 000 | 3 676 | 0,10 |
| 6,864 % éch. 17/10/2031 | 6 600 | 6 604 | 0,19 | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | Communauté autonome de Catalogne | | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 5,670 % éch. 25/01/2037 | 2 445 | 864 | 0,02 | 4,220 % éch. 26/04/2035 | 200 | 227 | 0,01 |
| 5,610 % éch. 25/07/2037 | 1 923 | 1 750 | 0,05 | 6,010 % éch. 25/05/2036 | 1 700 | 1 603 | 0,05 | Communauté autonome de Madrid | | | |
| 5,690 % éch. 25/09/2037 | 164 | 167 | 0,01 | 0,610 % éch. 25/05/2036 | 1 700 | 1 603 | 0,05 | 0,420 % éch. 30/04/2031 | 4 200 | 3 854 | 0,11 |
| 5,720 % éch. 25/02/2036 | 545 | 514 | 0,01 | OCP CLO Ltd. | | | | BNG Bank NV | | | |
| 5,930 % éch. 25/04/2047 | 5 554 | 5 036 | 0,14 | 6,797 % éch. 20/07/2029 | 1 950 | 1 951 | 0,06 | 0,250 % éch. 12/01/2032 | 4 000 | 3 658 | 0,10 |
| 6,445 % éch. 25/01/2036 | 1 954 | 1 898 | 0,05 | 4,882 % éch. 22/09/2034 | € 2 700 | 2 940 | 0,08 | 3,300 % éch. | | | |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | | Option One Mortgage Loan Trust | | | | 17/07/2028 | AUD 3 000 | 1 961 | 0,05 |
| 4,661 % éch. 27/01/2031 | € 5 587 | 6 088 | 0,17 | 5,610 % éch. 25/01/2037 | \$ 248 | 155 | 0,00 | Bpifrance Financement S.A. | | | |
| Dryden Euro CLO DAC | | | | 5,610 % éch. 25/03/2037 | 1 113 | 769 | 0,02 | 2,000 % éch. 02/09/2030 | € 4 200 | 4 454 | 0,12 |
| 4,862 % éch. 15/05/2034 | 1 248 | 1 357 | 0,04 | 5,650 % éch. 25/04/2037 | 2 964 | 1 415 | 0,04 | Obligation internationale du gouvernement canadien | | | |
| Encore Credit Receivables Trust | | | | OZLM Ltd. | | | | 2,750 % éch. | | | |
| 6,160 % éch. 25/07/2035 | \$ 422 | 406 | 0,01 | 6,674 % éch. 17/07/2029 | 1 162 | 1 161 | 0,03 | 01/12/2033 | CAD 31 300 | 24 047 | 0,67 |
| Fremont Home Loan Trust | | | | 6,682 % éch. 16/05/2030 | 2 150 | 2 148 | 0,06 | Obligation à rendement réel du gouvernement canadien | | | |
| 6,180 % éch. 25/06/2035 | 122 | 117 | 0,00 | 6,902 % éch. 30/10/2030 | 789 | 790 | 0,02 | 1,500 % éch. 01/12/2044 | 549 | 412 | 0,01 |
| Greenwood Park CLO Ltd. | | | | Palmer Square CLO Ltd. | | | | (c) | | | |
| 6,665 % éch. 15/04/2031 | 2 267 | 2 269 | 0,06 | 6,755 % éch. 16/07/2031 | 3 241 | 3 246 | 0,09 | Cassa Depositi e Prestiti SpA | | | |
| Griffith Park CLO DAC | | | | Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | 5,750 % éch. 05/05/2026 | \$ 5 300 | 5 296 | 0,15 |
| 4,704 % éch. 21/11/2031 | € 996 | 1 083 | 0,03 | 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 5 040 | 5 479 | 0,15 | Obligation internationale du gouvernement chinois | | | |
| GSAMP Trust | | | | 4,695 % éch. 15/07/2031 | 3 710 | 4 048 | 0,11 | 3,190 % éch. | | | |
| 5,970 % éch. 25/05/2046 | \$ 1 237 | 1 157 | 0,03 | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | 15/04/2053 | CNY 28 440 | 4 268 | 0,12 |
| 6,190 % éch. 25/11/2035 | 3 800 | 3 082 | 0,09 | 5,762 % éch. 25/08/2036 | \$ 708 | 282 | 0,01 | Communauté Française de Belgique | | | |
| Harvest CLO DAC | | | | Residential Asset Securities Corp. Trust | | | | 3,750 % éch. 22/06/2033 | € 16 300 | 19 080 | 0,54 |
| 4,566 % éch. 26/06/2030 | € 2 117 | 2 313 | 0,07 | 6,130 % éch. 25/12/2035 | 4 997 | 4 803 | 0,14 | CPPIB Capital, Inc. | | | |
| 4,605 % éch. 15/10/2031 | 3 126 | 3 396 | 0,10 | | | | | 1,500 % éch. | | | |
| | | | | | | | | 23/06/2028 | AUD 2 300 | 1 385 | 0,04 |
| | | | | | | | | Development Bank of Japan, Inc. | | | |
| | | | | | | | | 1,875 % éch. 02/10/2024 | \$ 3 900 | 3 806 | 0,11 |
| | | | | | | | | 2,125 % éch. 01/09/2026 | € 6 000 | 6 511 | 0,18 |

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 47 | \$ (218) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2025 | 2 602 | (3 409) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2024 | 214 | (30) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Long | 09/2025 | 650 | 972 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Long | 06/2024 | 2 202 | 895 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2024 | 688 | (440) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Long | 12/2025 | 650 | 969 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars | Court | 03/2024 | 73 | (53) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 877 | (1 979) | (0,06) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 409 | 661 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 1 083 | (2 359) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 400 | 1 986 | 0,06 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 88 | 168 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 15 | (190) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 13 | 53 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 94 | (70) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 69 | (581) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 68 | (184) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 710 | (2 533) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 166 | (946) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 20 | 1 966 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Long | 03/2024 | 175 | 1 964 | 0,06 |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 937 | (8 043) | (0,23) |
| | | | | \$ (13 483) | (0,38) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (13 483) | (0,38) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|---|-----------|-----------------|-------------------|---|---------------------|
| À payer ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,000 % | 17/06/2027 | £ 95 700 | \$ 227 | 0,01 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 17/06/2035 | 20 700 | (46) | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 13 800 | 2 297 | 0,06 |
| À payer ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 153 050 | 15 814 | 0,44 |
| À payer ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 165 300 | 6 979 | 0,20 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 30 200 | (965) | (0,03) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,250 | 20/03/2029 | INR 2 217 490 | 31 | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2029 | 440 980 | 16 | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2034 | 280 960 | (20) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/12/2028 | ¥ 180 000 | (14) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 17/03/2031 | 1 500 000 | (209) | (0,01) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,035 | 29/11/2029 | 1 500 000 | (161) | (0,01) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050 | 15/12/2031 | 3 010 000 | (443) | (0,01) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,200 | 19/06/2029 | 1 060 000 | (119) | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 19/06/2039 | 430 000 | 202 | 0,01 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,450 | 15/12/2051 | 505 230 | (192) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,550 | 14/09/2028 | 4 600 000 | (449) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,850 | 20/09/2033 | 820 000 | (27) | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,200 | 20/09/2053 | 20 000 | (6) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 20/03/2029 | SGD 100 811 | (704) | (0,02) |
| À recevoir | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,684 | 30/04/2025 | \$ 900 | 28 | 0,00 |
| À recevoir | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,696 | 30/04/2025 | 900 | 28 | 0,00 |
| À recevoir | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,710 | 30/04/2025 | 1 000 | 31 | 0,00 |
| À recevoir | Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour | 2,714 | 30/04/2025 | 1 900 | 59 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2028 | 5 300 | (43) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,430 | 31/03/2024 | 33 000 | (307) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 20 200 | (500) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/06/2052 | 13 400 | (2 129) | (0,06) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,518 | 20/01/2029 | 12 300 | (344) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,545 | 20/01/2029 | 8 200 | (231) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 20/01/2029 | 10 300 | (298) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 26/01/2029 | 2 300 | (65) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2024 | 139 200 | 1 631 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2052 | 27 180 | (887) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/12/2051 | 26 100 | (3 652) | (0,10) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 3 000 | (44) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 3 000 | (41) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 5 600 | (84) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,965 | 30/11/2026 | 67 260 | 1 975 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | 9 600 | (133) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 2 500 | (34) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,048 | 15/11/2032 | 8 100 | 285 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 08/09/2029 | 14 000 | (342) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,080 | 23/02/2053 | 3 070 | (167) | (0,01) |

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 % | 07/11/2024 | \$ 5 400 | \$ (62) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,089 | 15/11/2032 | 100 | 3 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100 | 09/09/2029 | 2 400 | (52) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,104 | 15/11/2032 | 2 990 | 91 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,139 | 15/11/2032 | 7 830 | 216 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 2 500 | (29) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,150 | 13/05/2025 | 277 800 | 1 943 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,163 | 30/09/2029 | 6 800 | (158) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,174 | 15/11/2032 | 12 000 | 299 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 2 500 | (28) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,200 | 13/05/2025 | 22 500 | 211 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,224 | 30/06/2024 | 7 091 | 136 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 2 600 | (28) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 30/09/2029 | 800 | (19) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 5 800 | (166) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 64 100 | (7 771) | (0,22) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,454 | 30/06/2029 | 3 610 | (46) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 4 900 | (63) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/06/2030 | 4 400 | (24) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 255 525 | 10 536 | 0,30 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,521 | 30/11/2027 | 19 640 | (100) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 700 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 4 600 | (42) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 6 200 | (56) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 5 500 | (77) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 5 100 | (41) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 5 200 | (40) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 38 900 | 659 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 79 700 | (2 625) | (0,07) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 1 950 | (38) | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2034 | 43 640 | 151 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 5 800 | (10) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 05/09/2028 | 2 580 | 33 | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 1 950 | (48) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 1 600 | (43) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,849 | 31/03/2030 | 3 000 | 45 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 3 400 | (96) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,857 | 31/03/2030 | 17 000 | 250 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,951 | 31/03/2030 | 41 600 | 874 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,988 | 30/11/2027 | 62 800 | 964 | 0,03 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 | 20/03/2054 | 15 200 | (302) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,050 | 10/10/2028 | 12 100 | 230 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,159 | 31/03/2025 | 34 000 | 516 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,193 | 30/11/2027 | 42 200 | 845 | 0,02 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,228 | 30/08/2025 | 40 500 | (172) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 394 553 | (3 222) | (0,09) |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2034 | 36 300 | 312 | 0,01 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,000 | 16/06/2026 | CAD 20 500 | 242 | 0,01 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,250 | 16/06/2031 | 19 300 | 210 | 0,01 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2025 | 600 | 7 | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2030 | 27 900 | 338 | 0,01 |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 3,250 | 15/03/2028 | 15 410 | 263 | 0,01 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 20/12/2028 | 24 600 | 327 | 0,01 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 21/06/2033 | 37 500 | 1 207 | 0,03 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 21/06/2053 | 2 600 | 243 | 0,01 |
| À payer ⁽¹⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 10/05/2025 | 385 200 | (609) | (0,02) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 01/06/2032 | 49 100 | (680) | (0,02) |
| À recevoir | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2033 | 36 200 | (1 383) | (0,04) |
| À payer ⁽¹⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,600 | 30/08/2025 | 50 500 | 361 | 0,01 |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,283 | 14/02/2027 | CHF 4 200 | (77) | 0,00 |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,294 | 10/02/2027 | 15 500 | (286) | (0,01) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,343 | 16/05/2027 | 6 300 | (97) | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | CNY 60 070 | 48 | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,250 | 20/03/2029 | KRW 11 383 400 | 44 | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,500 | 20/03/2034 | 4 433 800 | 31 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 0,528 | 17/03/2024 | NZD 950 | 24 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 3,750 | 15/06/2027 | 35 300 | (579) | (0,02) |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 4,000 | 14/06/2024 | 93 500 | (519) | (0,02) |
| À payer ⁽¹⁾ | BBR NZD à 3 mois | 5,000 | 20/03/2025 | 54 500 | 36 | 0,00 |
| À payer | STIBOR SEK à 3 mois | 1,000 | 19/06/2029 | SEK 11 700 | 19 | 0,00 |
| À recevoir | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,250 | 17/06/2030 | AUD 4 800 | (49) | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,750 | 16/03/2027 | 3 000 | 10 | 0,00 |
| À recevoir | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,750 | 16/06/2031 | 6 450 | (18) | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,000 | 21/06/2033 | 141 900 | 1 360 | 0,04 |
| À payer ⁽¹⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 15/09/2032 | 5 700 | (1) | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 15/03/2033 | 40 300 | (396) | (0,01) |
| À payer ⁽¹⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 15/09/2032 | 233 470 | 1 535 | 0,04 |
| À payer ⁽¹⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | 195 100 | 2 691 | 0,08 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,913 | 30/01/2029 | CZK 7 400 | 15 | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,054 | 27/05/2050 | € 600 | 73 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,064 | 17/11/2052 | 1 300 | 192 | 0,01 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,250 % | 15/09/2036 | € 1 400 | \$ (103) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | 6 000 | (193) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 4 300 | (127) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 3 300 | (108) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 30/03/2024 | 130 139 | (906) | (0,03) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 7 200 | (229) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 3 500 | (109) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | 18 200 | 47 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 41 200 | 119 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 9 300 | 28 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 26/04/2024 | 5 800 | 32 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 6 800 | 31 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 6 400 | 29 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 21/09/2037 | 11 890 | (246) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 21/09/2042 | 6 060 | (778) | (0,02) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 83 900 | (8 687) | (0,24) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 7 700 | (115) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 8 300 | (168) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 2 300 | (78) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 1 700 | (62) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 4 100 | (90) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 200 | (9) | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 19/03/2027 | 136 070 | 1 696 | 0,05 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 15/03/2033 | 58 910 | (777) | (0,02) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 231 490 | 12 230 | 0,34 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 1 600 | (80) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 2 800 | (160) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 100 | (3) | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 329 300 | 12 169 | 0,34 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 100 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 2 500 | (175) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 10 900 | 852 | 0,02 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 3 200 | (232) | (0,01) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 358 400 | 5 106 | 0,14 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,535 | 18/09/2025 | 133 100 | (1 404) | (0,04) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,536 | 18/09/2025 | 34 600 | (365) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 4,870 | 07/07/2025 | MXN 20 400 | 8 | 0,00 |
| | | | | | \$ 41 617 | 1,17 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 41 617 | 1,17 |

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 % | 15/07/2024 | 384 700 | \$ 769 | \$ 273 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,180 | 11/01/2024 | 8 600 | 246 | 920 | 0,02 |
| BRC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 66 300 | 89 | 2 | 0,00 |
| FAR | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 89 300 | 134 | 2 | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 89 100 | 138 | 2 | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 104 200 | 133 | 3 | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 107 200 | 148 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ 1 657 | \$ 1 205 | 0,03 |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BPS | Option de vente - Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052 hors cote | € 97,000 | 23/05/2025 | 2 200 | \$ 166 | \$ 904 | 0,03 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM | Option de vente - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 04/03/2024 | 4 378 | \$ (61) | \$ (127) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - USD contre TWD hors cote | 31,000 | 01/03/2024 | 11 402 | (154) | (328) | (0,01) |
| | | | | | \$ (215) | \$ (455) | (0,01) |

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,310 % | 11/01/2024 | 76 400 | \$ (246) | \$ (1 771) | (0,05) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 5,250 | 15/07/2024 | 384 700 | (385) | (92) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 2 200 | (10) | (28) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 2 200 | (10) | (1) | 0,00 |
| CBK | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 0,451 | 23/05/2025 | 2 200 | (166) | (835) | (0,03) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 4 400 | (17) | (13) | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 400 | (1) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 4 400 | (17) | (13) | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 2 600 | (12) | (19) | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 1 300 | (6) | (17) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 2 600 | (12) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 1 300 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 9 300 | (73) | (3) | 0,00 |
| BRC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 9 300 | (73) | (148) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 | 08/04/2024 | 2 800 | (21) | (1) | 0,00 |
| CBK | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 2 800 | (21) | (43) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 2 000 | (8) | (6) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 500 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 2 500 | (13) | (26) | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 2 500 | (12) | (32) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 2 100 | (10) | (34) | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 2 000 | (8) | (6) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 500 | (2) | (1) | 0,00 |
| BRC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 2 500 | (13) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 2 500 | (13) | 0 | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR GBP à 6 mois | À recevoir | 0,820 | 16/12/2024 | 20 100 | (142) | (24) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 1 700 | (7) | (5) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 2 100 | (10) | (33) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 1 700 | (7) | (6) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 2 100 | (10) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 400 | (1) | (6) | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 2 200 | (11) | (12) | 0,00 |
| BRC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 700 | (3) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 2 900 | (14) | (52) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 2 200 | (11) | 0 | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 700 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 2 900 | (14) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (1 394) | \$ (3 241) | (0,09) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 7 600 | \$ (222) | \$ (33) | \$ (255) | (0,01) |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) | 20/12/2028 | 7 800 | (222) | (40) | (262) | (0,01) |
| | | | | | \$ (444) | \$ (73) | \$ (517) | (0,02) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 % | 20/06/2025 | \$ 1 700 | \$ (41) | \$ 60 | \$ 19 | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 | 20/06/2025 | 1 100 | (27) | 40 | 13 | 0,00 |
| | | | | | \$ (68) | \$ 100 | \$ 32 | 0,00 |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|--|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| AZD | | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 04/01/2031 | AUD 14 600 | \$ 11 000 | \$ 72 | \$ (29) | \$ 43 | 0,00 |
| CBK | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,290 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | | | | | | | |
| GLM | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,420 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 31/07/2029 | | 5 100 | (1) | 16 | 15 | 0,00 |
| MYC | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,423 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 01/08/2029 | | 5 000 | (10) | 16 | 6 | 0,00 |
| | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,298 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 14/10/2030 | | 10 100 | 44 | (13) | 31 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 105 | \$ (10) | \$ 95 | 0,00 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/09/2028 | MYR 12 560 | \$ 67 | \$ (59) | \$ 8 | 0,00 |
| GST | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/09/2028 | 301 220 | 1 078 | (878) | 200 | 0,01 |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,600 | 20/09/2028 | 95 800 | (10) | (19) | (29) | 0,00 |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,750 | 20/09/2033 | 59 060 | 374 | (278) | 96 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 1 509 | \$ (1 234) | \$ 275 | 0,01 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 14 568 | \$ 9 650 | \$ 0 | \$ (292) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH | 19 752 | 2 740 | 0 | (49) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | CAD | 1 900 | 1 402 | 0 | (39) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 8 426 | 10 680 | 0 | (62) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 64 766 | 185 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 1 574 979 | 10 673 | 0 | (506) | (0,01) |
| | 01/2024 | NZD | 2 085 | 1 270 | 0 | (50) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 150 | MXN 2 547 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 310 | NOK 13 926 | 62 | 62 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | 3 063 | \$ 433 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 32 916 | 4 545 | 0 | (105) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 13 343 733 | 849 | 0 | (17) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 5 980 | INR 500 360 | 12 | 12 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 7 12 809 | \$ 548 | 0 | (7) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | DKK | 204 416 | 30 225 | 20 | (91) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 13 386 | 16 980 | 0 | (86) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 720 998 | 2 051 | 0 | (32) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 14 578 840 | 99 358 | 0 | (4 117) | (0,12) |
| | 01/2024 | KRW | 1 177 821 | 900 | 0 | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 6 179 | AUD 9 321 | 182 | 182 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 3 078 | BRL 15 202 | 52 | 52 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 5 398 | CAD 7 340 | 169 | 169 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 28 612 | € 26 128 | 267 | (10) | 0,01 |
| | 01/2024 | | 2 817 | £ 2 218 | 16 | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 | HUF 1 353 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 700 | IDR 10 827 425 | 3 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 155 | ¥ 164 400 | 12 | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 7 | KRW 9 649 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 13 191 | ZAR 244 535 | 163 | 163 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | 5 462 | \$ 769 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 188 295 | 5 924 | 0 | (299) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH | 225 115 | 31 293 | 0 | (503) | (0,01) |

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | IDR 48 864 725 | \$ 3 189 | \$ 20 | \$ 0 | \$ 20 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR 710 282 | 8 514 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ 6 873 647 | 46 691 | 0 | (2 516) | (2 516) | (0,07) |
| | 03/2024 | TWD 679 979 | 21 633 | 0 | (898) | (898) | (0,03) |
| | 03/2024 | \$ 1 393 | CNH 10 112 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 03/2024 | 6 402 | IDR 100 473 007 | 114 | 0 | 114 | 0,00 |
| | 03/2024 | 20 778 | INR 1 737 979 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 03/2024 | 122 | THB 4 248 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 04/2024 | DKK 86 673 | \$ 12 926 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 35 023 990 | 26 814 | 0 | (449) | (449) | (0,01) |
| BRC | 01/2024 | € 519 675 | 571 528 | 0 | (2 663) | (2 663) | (0,08) |
| | 01/2024 | ¥ 3 680 000 | 25 162 | 0 | (986) | (986) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 1 961 | € 1 794 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 01/2024 | 596 | ZAR 11 092 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 38 800 000 | \$ 261 538 | 0 | (15 888) | (15 888) | (0,45) |
| | 03/2024 | 7 996 353 | 54 300 | 0 | (2 945) | (2 945) | (0,08) |
| | 03/2024 | THB 102 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 301 | IDR 4 675 923 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 04/2024 | DKK 204 732 | \$ 30 585 | 107 | 0 | 107 | 0,00 |
| | 04/2024 | ¥ 1 690 042 | 13 839 | 1 687 | 0 | 1 687 | 0,05 |
| | 05/2024 | 1 370 000 | 11 081 | 1 187 | 0 | 1 187 | 0,03 |
| CBK | 06/2024 | KRW 39 110 028 | 30 004 | 0 | (440) | (440) | (0,01) |
| | 01/2024 | BRL 14 465 | 2 971 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF 14 237 | 16 407 | 0 | (518) | (518) | (0,01) |
| | 01/2024 | DKK 13 365 | 1 955 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 321 834 | 919 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR 9 257 123 | 601 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 3 342 300 | 23 672 | 0 | (51) | (51) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 840 262 | 650 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 299 | AUD 4 906 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 017 | CHF 887 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 263 | DKK 15 510 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 471 | £ 4 322 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| | 01/2024 | 700 | IDR 10 765 650 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | 10 178 | MXN 178 636 | 323 | 0 | 323 | 0,01 |
| | 01/2024 | 160 | NOK 1 716 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 549 | PLN 6 221 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 578 | ZAR 29 171 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 8 326 | \$ 442 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 158 320 | 22 317 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS 5 579 | 1 532 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN 11 581 | 3 076 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 355 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 4 844 | BRL 23 993 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 921 | CNH 13 900 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 287 | IDR 35 632 973 | 25 | (1) | 24 | 0,00 |
| | 04/2024 | 2 971 | BRL 14 611 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 7 493 446 | \$ 5 813 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| GLM | 06/2024 | \$ 9 | KRW 12 103 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 87 091 | \$ 64 087 | 0 | (1 969) | (1 969) | (0,06) |
| | 01/2024 | CHF 621 | 708 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK 165 984 | 24 485 | 0 | (119) | (119) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 12 692 000 | 90 158 | 0 | (108) | (108) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 148 | £ 901 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 20 324 | MXN 356 500 | 633 | 0 | 633 | 0,02 |
| | 01/2024 | 9 038 | PLN 36 188 | 163 | 0 | 163 | 0,00 |
| | 02/2024 | 21 832 | BRL 111 508 | 1 086 | 0 | 1 086 | 0,03 |
| | 03/2024 | CNH 134 717 | \$ 18 668 | 0 | (360) | (360) | (0,01) |
| | 03/2024 | SGD 1 614 | 1 220 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 2 045 | IDR 31 448 395 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 341 | TWD 72 515 | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| JPM | 06/2024 | KRW 2 674 367 | \$ 2 062 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 1 262 781 | 3 601 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 551 | KRW 712 886 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 102 | BRL 15 214 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 15 679 | \$ 2 174 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 03/2024 | CZK 2 716 | 121 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 40 671 010 | 2 623 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD 7 280 | 5 490 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 279 806 | 9 000 | 0 | (272) | (272) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 1 543 | IDR 23 821 605 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 6 231 | INR 520 920 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 03/2024 | 8 096 | TWD 250 676 | 199 | 0 | 199 | 0,01 |
| | 06/2024 | KRW 35 014 695 | \$ 27 003 | 1 | (254) | (253) | (0,01) |
| MBC | 10/2024 | ¥ 4 060 000 | 32 677 | 2 728 | 0 | 2 728 | 0,08 |
| | 01/2024 | AUD 12 832 | 8 505 | 0 | (252) | (252) | (0,01) |
| | 01/2024 | CAD 6 668 | 4 927 | 0 | (130) | (130) | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK 11 825 | 1 736 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 25 664 | 28 062 | 0 | (294) | (294) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ 10 888 400 | 76 400 | 0 | (882) | (882) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 6 919 | € 6 337 | 83 | 0 | 83 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 741 | £ 2 165 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|-------------|--------|
| | 01/2024 | \$ | HUF | 689 | 253 318 | \$ 41 | \$ 0 | \$ 41 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | \$ | 366 | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | | 4 110 103 | 33 566 | 4 155 | 0 | 4 155 | 0,12 |
| | 03/2024 | \$ | IDR | 1 882 | 29 015 105 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10/2024 | ¥ | \$ | 2 760 000 | 22 134 | 1 776 | 0 | 1 776 | 0,05 |
| MYI | 01/2024 | CAD | | 3 687 | 2 796 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | | 900 | 995 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | | 192 | 245 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | | 675 200 | 1 919 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | | 598 280 | 4 058 | 0 | (188) | (188) | (0,01) |
| | 01/2024 | MYR | | 10 355 | 2 219 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | € | 740 | 666 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | | £ | 689 | 540 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | ZAR | 202 | 3 719 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | \$ | 3 198 | 452 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | | 18 849 | 2 614 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | | 4 650 000 | 31 962 | 0 | (1 364) | (1 364) | (0,04) |
| | 03/2024 | \$ | IDR | 8 632 | 133 390 589 | 29 | (11) | 18 | 0,00 |
| | 04/2024 | DKK | \$ | 86 200 | 12 983 | 150 | 0 | 150 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | | 16 477 857 | 12 669 | 0 | (158) | (158) | 0,00 |
| RBC | 04/2024 | \$ | MXN | 29 | 515 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | AUD | \$ | 6 261 | 4 209 | 0 | (64) | (64) | 0,00 |
| | 04/2024 | DKK | | 55 000 | 8 260 | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | MYR | | 101 239 | 21 674 | 0 | (418) | (418) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | £ | 50 | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | \$ | 11 925 | 1 654 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | | 21 910 | 3 026 | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | | 7 040 723 | 449 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB | | 234 875 | 6 795 | 0 | (132) | (132) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | | 606 584 | 19 418 | 0 | (681) | (681) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ | IDR | 1 068 | 16 590 288 | 12 | (4) | 8 | 0,00 |
| | 03/2024 | | INR | 13 136 | 1 098 530 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 03/2024 | | TWD | 7 241 | 225 235 | 222 | 0 | 222 | 0,01 |
| | 06/2024 | KRW | \$ | 18 320 811 | 14 114 | 0 | (148) | (148) | 0,00 |
| SSB | 03/2024 | IDR | | 296 373 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | | 53 261 | 1 719 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| TOR | 03/2024 | CNH | | 10 596 | 1 468 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | | 6 253 296 | 396 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | AUD | | 4 797 | 3 182 | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | | 35 194 | 25 946 | 0 | (748) | (748) | (0,02) |
| | 01/2024 | £ | | 73 350 | 92 826 | 0 | (684) | (684) | (0,02) |
| | 01/2024 | MXN | | 12 407 | 701 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | CAD | 751 | 1 020 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 01/2024 | | NOK | 7 417 | 79 117 | 375 | 0 | 375 | 0,01 |
| | 01/2024 | | ZAR | 2 765 | 52 784 | 117 | 0 | 117 | 0,00 |
| | 03/2024 | | IDR | 4 737 | 74 875 658 | 118 | 0 | 118 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 17 017 | \$ (43 742) | \$ (26 725) | (0,75) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Z en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|----------|------|
| AZD | 01/2024 | \$ | AUD | 154 212 | 232 571 | \$ 4 513 | \$ 0 | \$ 4 513 | 0,13 |
| BOA | 01/2024 | | | 12 732 | 19 251 | 406 | 0 | 406 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | AUD | \$ | 1 834 | 1 236 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | AUD | 336 | 499 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | | | 289 | 440 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | AUD | \$ | 1 584 | 1 083 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | AUD | 666 | 988 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | | | 1 047 | 1 558 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | | | 58 910 | 88 839 | 1 721 | 0 | 1 721 | 0,05 |
| RYL | 01/2024 | | | 16 282 | 24 650 | 541 | 0 | 541 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | | | 74 332 | 112 036 | 2 130 | 0 | 2 130 | 0,06 |
| | | | | | | \$ 9 356 | \$ (16) | \$ 9 340 | 0,26 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 78 | \$ 91 | \$ 0 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 242 | CHF 207 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF 184 | \$ 213 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 25 282 | CHF 22 052 | 932 | 0 | 932 | 0,03 |
| CBK | 01/2024 | CHF 642 | \$ 741 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 645 | CHF 561 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CHF 69 | \$ 79 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 220 127 | CHF 192 903 | 9 188 | 0 | 9 188 | 0,26 |
| MYI | 01/2024 | CHF 44 | \$ 50 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 220 835 | CHF 192 773 | 8 326 | 0 | 8 326 | 0,23 |
| SCX | 01/2024 | CHF 482 | \$ 576 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 359 | CHF 312 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 202 947 | 177 088 | 7 568 | 0 | 7 568 | 0,21 |
| | | | | \$ 26 055 | \$ (35) | \$ 26 020 | 0,73 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (exposition au risque de change) de distribution et Institutions en EUR (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 6 | AUD 9 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | COP 3 700 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | PEN 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 | AUD 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | CNY 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 | £ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 46 | ¥ 6 798 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | KRW 182 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | NZD 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | PEN 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 | SGD 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 1 | COP 3 700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 0 | PEN 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | THB 128 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 0 | CHF 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | CNY 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | COP 3 700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 7 | € 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | £ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 | IDR 57 162 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | KRW 72 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | DKK 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 49 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 | CNY 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 10 | KRW 12 964 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | NOK 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | RON 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 | MXN 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CLP 548 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR 13 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 22 | CAD 30 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 | CHF 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 76 | CNY 536 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | CZK 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | HUF 322 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | ILS 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | ¥ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 | MYR 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | PLN 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 1 | CLP 548 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 | MYR 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 | CLP 548 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 181 | € 165 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | ¥ 53 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 | MXN 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 1 | CAD 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | KRW 11 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 1 | DKK 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 31 | £ 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 44 | ¥ 6 456 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | NOK 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | PLN 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 | SEK 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 6 | \$ 0 | \$ 6 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 16 139 | \$ 17 675 | \$ 1 | \$ (158) | \$ (157) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 336 174 | € 305 707 | 1 603 | (1) | 1 602 | 0,05 |
| BRC | 01/2024 | 343 423 | 312 265 | 1 600 | 0 | 1 600 | 0,04 |
| CBK | 01/2024 | € 2 260 | \$ 2 468 | 1 | (30) | (29) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 010 | € 2 787 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 2 305 | \$ 2 531 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 83 613 | € 76 897 | 1 351 | 0 | 1 351 | 0,04 |
| UAG | 01/2024 | 343 480 | 312 265 | 1 543 | 0 | 1 543 | 0,04 |
| | | | | \$ 6 168 | \$ (205) | \$ 5 963 | 0,17 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 174 | \$ 220 | \$ 0 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 12 930 | £ 10 203 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 14 365 | 11 324 | 73 | (1) | 72 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 244 | 193 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 4 635 | \$ 5 886 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 715 | £ 565 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 41 | 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 1 293 | \$ 1 639 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 12 704 | 15 988 | 0 | (208) | (208) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 155 | £ 123 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 81 901 | 64 750 | 645 | 0 | 645 | 0,02 |
| SSB | 01/2024 | 52 949 | 41 961 | 545 | 0 | 545 | 0,02 |
| UAG | 01/2024 | £ 99 | \$ 123 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 81 882 | £ 64 700 | 600 | 0 | 600 | 0,02 |
| | | | | \$ 1 950 | \$ (245) | \$ 1 705 | 0,05 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 153 483 | NOK 1 631 931 | \$ 7 232 | \$ 0 | \$ 7 232 | 0,20 |
| BPS | 01/2024 | 13 623 | 140 221 | 186 | 0 | 186 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | 98 339 | 1 052 939 | 5 356 | 0 | 5 356 | 0,15 |
| GLM | 01/2024 | NOK 144 778 | \$ 13 896 | 0 | (363) | (363) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 70 956 | NOK 762 924 | 4 178 | 0 | 4 178 | 0,12 |
| MYI | 01/2024 | 2 137 | 22 937 | 122 | 0 | 122 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | NOK 33 828 | \$ 3 108 | 0 | (223) | (223) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 7 630 | NOK 79 218 | 172 | 0 | 172 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | 1 219 | 13 114 | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 248 490 | 2 647 814 | 12 273 | 0 | 12 273 | 0,35 |
| | | | | \$ 29 592 | \$ (586) | \$ 29 006 | 0,82 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NZD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 13 742 | NZD 22 553 | \$ 538 | \$ 0 | \$ 538 | 0,02 |
| BRC | 01/2024 | 13 808 | 22 445 | 403 | 0 | 403 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 14 328 | 23 215 | 371 | 0 | 371 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 312 | \$ 0 | \$ 1 312 | 0,04 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 12 774 | SEK 133 234 | \$ 450 | \$ 0 | \$ 450 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 163 | 1 675 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | SEK 4 647 | \$ 444 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 031 | SEK 21 114 | 66 | (1) | 65 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SEK 2 122 | \$ 208 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 55 | SEK 561 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SEK 2 418 | \$ 231 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 69 | SEK 685 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 13 615 | 141 403 | 420 | 0 | 420 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 14 020 | 144 651 | 337 | 0 | 337 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 276 | \$ (30) | \$ 1 246 | 0,03 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 46 171 1,30

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Ginnie Mae, TBA | | | |
| 4,500 % éch. 01/02/2054 | \$ 200 | \$ (195) | (0,01) |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 2,000 % éch. 01/01/2039 | 29 000 | (26 005) | (0,73) |
| 2,000 % éch. 01/01/2054 | 15 550 | (12 712) | (0,36) |
| 2,000 % éch. 01/02/2054 | 99 000 | (81 025) | (2,27) |
| 3,000 % éch. 01/02/2054 | 19 500 | (17 270) | (0,48) |
| 4,000 % éch. 01/01/2054 | 100 | (95) | 0,00 |
| 4,000 % éch. 01/02/2054 | 27 000 | (25 563) | (0,72) |
| 4,500 % éch. 01/02/2054 | 35 610 | (34 543) | (0,97) |
| 5,500 % éch. 01/01/2054 (d) | 80 000 | (80 350) | (2,26) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (277 758) | (7,80) |
| Total des Investissements | | \$ 3 958 440 | 111,16 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (397 260) | (11,16) |
| Actifs nets | | \$ 3 561 180 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
- (b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (j) Le titre vendu à découvert au 31 décembre 2023 est couvert par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

Un montant en numéraire de 84 363 \$ (31 décembre 2022 : 78 217 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 23 400 \$ (31 décembre 2022 : 44 770 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|--|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 3 995 856 | \$ 79 | \$ 3 995 935 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 165 958 | 0 | 165 958 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (10 719) | 85 024 | 0 | 74 305 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (277 758) | 0 | (277 758) |
| Totaux | \$ (10 719) | \$ 3 969 080 | \$ 79 | \$ 3 958 440 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|--|--|--|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 2 913 880 | \$ 0 | \$ 2 913 880 |
| Fonds d'investissement | 5 649 | 0 | 0 | 5 649 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 157 847 | 0 | 1 157 847 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 10 275 | (67 767) | 0 | (57 492) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (119 122) | 0 | (119 122) |
| Totaux | \$ 15 924 | \$ 3 884 838 | \$ 0 | \$ 3 900 762 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 4 215 | \$ (4 700) | \$ (485) | \$ 569 | \$ (270) | \$ 299 |
| BOA | 7 328 | (7 150) | 178 | (19 412) | 16 030 | (3 382) |
| BOM | S/O | S/O | S/O | 68 | 0 | 68 |
| BPS | (6 163) | 5 020 | (1 143) | (119) | 70 | (49) |
| BRC | (16 941) | 17 930 | 989 | 511 | (350) | 161 |
| CBK | 5 364 | (5 430) | (66) | 21 756 | (21 180) | 576 |
| FAR | (34) | 0 | (34) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 11 917 | (11 610) | 307 | (1 813) | 1 600 | (213) |
| GSC | S/O | S/O | S/O | (6) | 0 | (6) |
| GST | 12 | 140 | 152 | (69) | 70 | 1 |
| HUS | S/O | S/O | S/O | (2) | 0 | (2) |
| JPM | 1 887 | (1 950) | (63) | 634 | (560) | 74 |
| MBG | 7 534 | (7 150) | (216) | (11 665) | 10 830 | (835) |
| MYC | (300) | 310 | 10 | (127) | 50 | (77) |
| MYI | 6 573 | (7 840) | (1 267) | (1 837) | 1 310 | (527) |
| RBC | 1 | 0 | 1 | 128 | 0 | 128 |
| RYL | 498 | (270) | 228 | (29) | 0 | (29) |
| SCX | (84) | (230) | (314) | 9 488 | (8 580) | 908 |
| SSB | 499 | (430) | 69 | 488 | (420) | 68 |
| TOR | (38) | 0 | (38) | (8 559) | 7 570 | (989) |
| UAG | 23 903 | (24 320) | (417) | (8 383) | 7 240 | (1 143) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 69,21 | 34,52 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 43,00 | 58,42 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 0,85 |
| Fonds d'investissement | S/O | 0,18 |
| Contrats de mise en pension | 4,66 | 37,28 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,38) | 0,30 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 1,17 | (1,56) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 1,30 | (0,59) |
| Titres vendus à découvert | (7,80) | (3,83) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 19,62 | 15,77 |
| Obligations et billets municipaux | 0,10 | 0,00 |
| Agences du gouvernement américain | 35,91 | 16,84 |
| Obligations du Trésor américain | 6,43 | 3,33 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 3,21 | 3,93 |
| Titres adossés à des actifs | 7,96 | 8,18 |
| Émissions souveraines | 18,36 | 10,32 |
| Titres privilégiés | S/O | 0,00 |
| Instruments à court terme | 20,62 | 35,42 |
| Fonds d'investissement | S/O | 0,18 |
| Contrats de mise en pension | 4,66 | 37,28 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,38) | 0,30 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | 0,00 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base | S/O | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 1,17 | (1,56) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,03 | 0,03 |
| Options sur titres | 0,03 | 0,03 |
| Options vendues | | |
| Options de change | (0,01) | S/O |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,09) | (0,15) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,02) | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps sur devises croisées | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | (0,01) |
| Contrats de change à terme | (0,75) | (1,97) |
| Contrats de change à terme couverts | 2,10 | 1,48 |
| Titres vendus à découvert | (7,80) | (3,83) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (11,16) | (25,57) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | PORTUGAL OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| AerCap Ireland Capital DAC | | | | Miravet SARL | | | | Banco Espírito Santo S.A. | | | |
| 1,650 % éch. 29/10/2024 | \$ 500 | \$ 483 | 0,06 | 4,806 % éch. 26/05/2065 | € 839 | \$ 919 | 0,12 | 4,000 % éch. 21/01/2019 ^ | € 400 | 121 | 0,01 |
| 1,750 % éch. 29/10/2024 | 500 | 483 | 0,06 | Total Luxembourg | | 5 567 | 0,70 | 4,750 % éch. 15/01/2018 ^ | 700 | 213 | 0,03 |
| AIB Group PLC | | | | | | | | Total Portugal | | 334 | 0,04 |
| 5,250 % éch. 23/10/2031 | € 2 000 | 2 390 | 0,30 | | | | | | | | |
| | | 3 356 | 0,42 | MALAISIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | QATAR OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Total Irlande | | 45 709 | 5,71 | Petronas Capital Ltd. | | | | QatarEnergy | | | |
| ISRAËL ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,480 % éch. 28/01/2032 | \$ 400 | 342 | 0,04 | 2,250 % éch. 12/07/2031 | \$ 400 | 341 | 0,04 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien | | | | 3,500 % éch. 21/04/2030 | 400 | 376 | 0,05 | ROUMANIE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 2,000 % éch. 31/03/2027 | ILS 7 600 | 2 006 | 0,25 | 4,550 % éch. 21/04/2050 | 300 | 276 | 0,03 | Obligation internationale du gouvernement roumain | | | |
| 4,500 % éch. 17/01/2033 | \$ 500 | 476 | 0,06 | 4,800 % éch. 21/04/2060 | 300 | 285 | 0,04 | 1,375 % éch. 02/12/2029 | € 630 | 575 | 0,07 |
| 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 7 200 | 8 140 | 1,02 | | | 1 279 | 0,16 | 1,750 % éch. 13/07/2030 | 1 000 | 896 | 0,11 |
| Total Israël | | 10 622 | 1,33 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,000 % éch. 28/01/2032 | 600 | 514 | 0,06 |
| ITALIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Obligation internationale du gouvernement malaisien | | | | 2,000 % éch. 14/04/2033 | 700 | 581 | 0,07 |
| AMCO - Asset Management Co. SpA | | | | 3,519 % éch. 20/04/2028 | MYR 44 429 | 9 652 | 1,21 | 2,124 % éch. 16/07/2031 | 400 | 353 | 0,04 |
| 4,625 % éch. 06/02/2027 | 1 100 | 1 250 | 0,16 | Total Malaisie | | 10 931 | 1,37 | 2,625 % éch. 02/12/2040 | 600 | 447 | 0,06 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | | | | MEXIQUE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,875 % éch. 13/04/2042 | 800 | 600 | 0,08 |
| 0,875 % éch. 08/10/2027 | 200 | 206 | 0,03 | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | | 3,750 % éch. 07/02/2034 | 800 | 763 | 0,10 |
| 2,000 % éch. 29/01/2024 | 2 200 | 2 427 | 0,30 | 4,000 % éch. 15/03/2115 | € 400 | 343 | 0,04 | 5,000 % éch. 27/09/2026 | 1 700 | 1 931 | 0,24 |
| 2,625 % éch. 28/04/2025 | 100 | 108 | 0,01 | MULTINATIONALES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Total Roumanie | | 6 660 | 0,83 |
| 6,750 % éch. 05/09/2027 | 700 | 810 | 0,10 | Preferred Term Securities Ltd. | | | | ARABIE SAOUDITE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Intesa Sanpaolo SpA | | | | 6,039 % éch. 23/06/2035 | \$ 764 | 733 | 0,09 | Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite | | | |
| 5,125 % éch. 29/08/2031 | 1 000 | 1 180 | 0,15 | PAYS-BAS OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,250 % éch. 22/10/2030 | \$ 400 | 371 | 0,05 |
| | | 5 981 | 0,75 | Cooperatieve Rabobank UA | | | | 4,750 % éch. 18/01/2028 | 1 900 | 1 922 | 0,24 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 3,758 % éch. 06/04/2033 | 600 | 539 | 0,07 | 4,875 % éch. 18/07/2033 | 2 200 | 2 250 | 0,28 |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA | | | | MEXIQUE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Total Arabie saoudite | | 4 543 | 0,57 |
| 4,625 % éch. 05/05/2026 | \$ 1 100 | 1 099 | 0,14 | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | | SERBIE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement italien | | | | 4,000 % éch. 15/03/2115 | € 400 | 343 | 0,04 | Obligation internationale du gouvernement serbe | | | |
| 6,000 % éch. 04/08/2028 | £ 100 | 134 | 0,01 | MULTINATIONALES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 1,000 % éch. 23/09/2028 | € 600 | 561 | 0,07 |
| | | 1 233 | 0,15 | Preferred Term Securities Ltd. | | | | 2,050 % éch. 23/09/2036 | 900 | 694 | 0,09 |
| Total Italie | | 7 214 | 0,90 | 6,039 % éch. 23/06/2035 | \$ 764 | 733 | 0,09 | Total Serbie | | 1 255 | 0,16 |
| JAPON OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | PAYS-BAS OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | SINGAPOUR ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | | Cooperatieve Rabobank UA | | | | Obligation internationale du gouvernement singapourien | | | |
| 0,409 % éch. 07/11/2029 | € 1 800 | 1 699 | 0,21 | 3,758 % éch. 06/04/2033 | 600 | 539 | 0,07 | 2,250 % éch. 01/08/2036 | SGD 2 300 | 1 657 | 0,21 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | | MEXIQUE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 3,375 % éch. 01/09/2033 | 320 | 257 | 0,03 |
| 0,010 % éch. 15/10/2027 | 2 000 | 1 968 | 0,25 | CTP NV | | | | Total Singapour | | 1 914 | 0,24 |
| | | 3 667 | 0,46 | 0,625 % éch. 27/09/2026 | € 600 | 597 | 0,07 | SLOVÉNIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 0,875 % éch. 20/01/2026 | 900 | 922 | 0,12 | Nova Kreditna Banka Maribor d.d. | | | |
| Obligation internationale du gouvernement japonais | | | | 1,500 % éch. 27/09/2031 | 600 | 518 | 0,07 | 1,875 % éch. 27/01/2025 | € 700 | 770 | 0,10 |
| 0,005 % éch. 01/03/2024 | ¥ 620 000 | 4 399 | 0,55 | ING Groep NV | | | | Nova Ljubljanska Banka d.d. | | | |
| 0,005 % éch. 01/04/2024 | 690 000 | 4 896 | 0,61 | 2,125 % éch. 23/05/2026 | 400 | 432 | 0,05 | 3,400 % éch. 05/02/2030 | 1 000 | 959 | 0,12 |
| 0,005 % éch. 01/05/2024 | 310 000 | 2 200 | 0,28 | | | 3 008 | 0,38 | Total Slovénie | | 1 729 | 0,22 |
| 0,005 % éch. 01/10/2024 | 1 320 000 | 9 368 | 1,17 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | CORÉE DU SUD ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 0,100 % éch. 10/03/2028 (d) | 1 039 952 | 7 753 | 0,97 | Jubilee Place BV | | | | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | | | |
| 0,500 % éch. 20/03/2049 | 976 000 | 5 372 | 0,67 | 4,985 % éch. 17/10/2057 | 826 | 915 | 0,11 | 1,375 % éch. 10/12/2029 | KRW 1 834 280 | 1 290 | 0,16 |
| 0,700 % éch. 20/12/2048 | 1 188 000 | 6 913 | 0,87 | Total Pays-Bas | | 3 923 | 0,49 | 1,500 % éch. 10/12/2030 | 1 622 130 | 1 129 | 0,14 |
| 0,700 % éch. 20/09/2051 | 660 000 | 3 712 | 0,46 | NOUVELLE-ZÉLANDE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,000 % éch. 10/06/2031 | 1 769 360 | 1 267 | 0,16 |
| 1,500 % éch. 20/09/2043 | 710 000 | 5 130 | 0,64 | Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais | | | | 2,125 % éch. 10/06/2027 | 2 095 000 | 1 571 | 0,20 |
| Gouvernement de la métropole de Tokyo | | | | 1,500 % éch. 15/05/2031 | NZD 1 300 | 681 | 0,08 | 2,375 % éch. 10/12/2027 | 2 480 000 | 1 870 | 0,23 |
| 0,750 % éch. 16/07/2025 | \$ 800 | 751 | 0,09 | NORVÈGE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,375 % éch. 10/12/2028 | 13 776 070 | 10 322 | 1,29 |
| | | 50 494 | 6,31 | Kommunalbanken A/S | | | | 2,625 % éch. 10/06/2028 | 7 891 650 | 5 998 | 0,75 |
| Total Japon | | 54 161 | 6,77 | 1,900 % éch. 19/01/2027 | AUD 1 600 | 1 018 | 0,13 | 3,250 % éch. 10/03/2028 | 1 472 700 | 1 158 | 0,15 |
| LUXEMBOURG OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | PÉROU OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Aroundtown S.A. | | | | Banco de Credito del Peru S.A. | | | | Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | |
| 0,000 % éch. 16/07/2026 (b) | € 700 | 651 | 0,08 | 4,650 % éch. 17/09/2024 | PEN 2 400 | 630 | 0,08 | 6,150 % éch. 12/08/2032 | 100 | 26 | 0,00 |
| 0,375 % éch. 15/04/2027 | 100 | 89 | 0,01 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Total Pérou | | 656 | 0,08 |
| CPI Property Group S.A. | | | | Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | | POLOGNE ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 2,750 % éch. 12/05/2026 | 2 100 | 1 942 | 0,24 | 6,150 % éch. 12/08/2032 | 100 | 26 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement polonais | | | |
| Cromwell Ereit Lux Finco SARL | | | | | | | | 3,875 % éch. 14/02/2033 | € 900 | 1 037 | 0,13 |
| 2,125 % éch. 19/11/2025 | 500 | 522 | 0,07 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | |
| Logicor Financing SARL | | | | Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| 0,625 % éch. 17/11/2025 | 1 400 | 1 444 | 0,18 | 6,150 % éch. 12/08/2032 | 100 | 26 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | | | |
| | | 4 648 | 0,58 | | | | | 1,375 % éch. 10/12/2029 | KRW 1 834 280 | 1 290 | 0,16 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 3,250 % éch. 10/06/2033 KRW | 3 580 720 | \$ 2 795 | 0,35 | 4,041 % éch. 13/03/2028 | \$ 300 | \$ 289 | 0,04 | MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 3,250 % éch. 10/09/2042 | 746 990 | 589 | 0,07 | 4,583 % éch. 19/06/2029 | 1 300 | 1 262 | 0,16 | 5,710 % éch. 25/10/2036 | \$ 1 960 | \$ 1 717 | 0,22 |
| 4,250 % éch. 10/12/2032 | 10 509 430 | 8 820 | 1,10 | NatWest Markets PLC | | | | 5,790 % éch. 25/08/2036 | 5 020 | 1 858 | 0,23 |
| 5,500 % éch. 10/03/2028 | 2 480 000 | 2 099 | 0,26 | 0,125 % éch. 12/11/2025 | € 1 000 | 1 041 | 0,13 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | |
| Total Corée du Sud | | 38 908 | 4,86 | Santander UK Group Holdings PLC | | | | 5,630 % éch. 25/09/2037 | 4 | 1 | 0,00 |
| ESPAGNE | | | | 7,482 % éch. 29/08/2029 | £ 1 800 | 2 497 | 0,31 | 5,710 % éch. 25/02/2037 | 2 987 | 897 | 0,11 |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | Standard Chartered PLC | | | | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | |
| BBVA Consumer Auto | | | | 1,822 % éch. 23/11/2025 | \$ 1 800 | 1 734 | 0,22 | 5,570 % éch. 25/11/2036 | 1 099 | 625 | 0,08 |
| 0,270 % éch. 20/07/2031 | € 192 | 207 | 0,02 | 2,678 % éch. 29/06/2032 | 2 700 | 2 198 | 0,28 | 5,720 % éch. 25/07/2036 | 95 | 83 | 0,01 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | TP ICAP Finance PLC | | | | New Century Home Equity Loan Trust | | | |
| Banco Santander S.A. | | | | 2,625 % éch. 18/11/2028 | £ 700 | 747 | 0,09 | 3,699 % éch. 20/06/2031 | 244 | 221 | 0,03 |
| 1,849 % éch. 25/03/2026 | \$ 200 | 185 | 0,02 | | | 17 959 | 2,25 | Option One Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,607 % éch. 07/11/2028 | 1 000 | 1 066 | 0,14 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON EMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | 5,610 % éch. 25/01/2037 | 549 | 343 | 0,04 |
| | | 1 251 | 0,16 | Canada Square Funding PLC | | | | 5,610 % éch. 25/02/2037 | 1 999 | 1 297 | 0,16 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 6,000 % éch. 17/06/2058 | 1 011 | 1 283 | 0,16 | Residential Asset Securities Corp. Trust | | | |
| Communauté autonome de Catalogne | | | | Eurosail PLC | | | | 6,130 % éch. 25/11/2035 | 16 | 16 | 0,00 |
| 4,220 % éch. 26/04/2035 | € 400 | 454 | 0,06 | 6,289 % éch. 13/06/2045 | 388 | 493 | 0,06 | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | | Genesis Mortgage Funding PLC | | | | 5,590 % éch. 25/12/2036 | 14 | 3 | 0,00 |
| 1,450 % éch. 31/10/2071 | 2 200 | 1 228 | 0,15 | 6,420 % éch. 15/09/2059 | 2 017 | 2 580 | 0,32 | SLC Student Loan Trust | | | |
| 1,900 % éch. 31/10/2052 | 300 | 230 | 0,03 | Mansard Mortgages PLC | | | | 6,481 % éch. 25/11/2042 | 250 | 250 | 0,03 |
| 3,450 % éch. 30/07/2066 | 4 200 | 4 350 | 0,54 | 5,989 % éch. 15/12/2049 | 347 | 436 | 0,06 | Soundview Home Loan Trust | | | |
| 5,250 % éch. 06/04/2029 | £ 500 | 671 | 0,09 | Newgate Funding PLC | | | | 5,875 % éch. 25/12/2036 | 2 601 | 2 536 | 0,32 |
| | | 6 933 | 0,87 | 4,525 % éch. 15/12/2050 | € 395 | 428 | 0,05 | 5,970 % éch. 25/11/2036 | 2 022 | 1 903 | 0,24 |
| Total Espagne | | 8 391 | 1,05 | Polaris PLC | | | | 6,175 % éch. 25/11/2035 | 179 | 176 | 0,02 |
| SUPRANATIONALES | | | | 5,985 % éch. 23/12/2058 | £ 794 | 1 010 | 0,13 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Ripon Mortgages PLC | | | | 6,957 % éch. 25/04/2035 | 25 | 25 | 0,00 |
| Banque interaméricaine de développement | | | | 5,920 % éch. 28/08/2056 | 4 992 | 6 345 | 0,79 | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. | | | |
| 2,500 % éch. 14/04/2027 AUD | 1 300 | 843 | 0,11 | RMAC PLC | | | | 5,102 % éch. 01/04/2035 | 400 | 408 | 0,05 |
| SUÈDE | | | | 0,000 % éch. 15/02/2047 | 3 000 | 3 837 | 0,48 | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Stratton Mortgage Funding PLC | | | | 5,815 % éch. 25/01/2037 | 1 950 | 1 882 | 0,24 |
| EQT AB | | | | 6,120 % éch. 12/03/2052 | 1 088 | 1 387 | 0,17 | | | 20 884 | 2,61 |
| 2,375 % éch. 06/04/2028 | € 700 | 732 | 0,09 | 6,121 % éch. 20/07/2060 | 2 063 | 2 630 | 0,33 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| SUISSE | | | | Towd Point Mortgage Funding PLC | | | | American Tower Corp. | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,365 % éch. 20/10/2051 | 855 | 1 091 | 0,14 | 2,950 % éch. 15/01/2025 | 1 400 | 1 367 | 0,17 |
| Credit Suisse AG | | | | 6,571 % éch. 20/07/2045 | 2 133 | 2 727 | 0,34 | 3,800 % éch. 15/08/2029 | 800 | 760 | 0,10 |
| 3,625 % éch. 09/09/2024 | \$ 500 | 493 | 0,06 | Trinity Square PLC | | | | Bank of America Corp. | | | |
| UBS Group AG | | | | 6,070 % éch. 15/07/2059 | 961 | 1 226 | 0,15 | 1,949 % éch. 27/10/2026 | € 1 000 | 1 073 | 0,13 |
| 3,869 % éch. 12/01/2029 | 1 150 | 1 085 | 0,14 | | | 25 473 | 3,18 | 3,384 % éch. 02/04/2026 | \$ 600 | 584 | 0,07 |
| 4,282 % éch. 09/01/2028 | 450 | 436 | 0,05 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Charter Communications Operating LLC | | | |
| 4,488 % éch. 12/05/2026 | 400 | 394 | 0,05 | Bon du Trésor britannique | | | | 3,500 % éch. 01/03/2042 | 1 000 | 696 | 0,09 |
| 4,550 % éch. 17/04/2026 | 750 | 741 | 0,09 | 0,625 % éch. 22/10/2050 | 2 700 | 1 520 | 0,19 | 5,125 % éch. 01/07/2049 | 700 | 589 | 0,07 |
| 6,327 % éch. 22/12/2027 | 1 100 | 1 134 | 0,14 | 1,250 % éch. 31/07/2051 | 3 500 | 2 378 | 0,30 | 6,384 % éch. 23/10/2035 | 800 | 813 | 0,10 |
| 6,373 % éch. 15/07/2026 | 1 250 | 1 265 | 0,16 | 1,500 % éch. 31/07/2053 | 1 600 | 1 137 | 0,14 | Citigroup, Inc. | | | |
| 6,442 % éch. 11/08/2028 | 1 100 | 1 143 | 0,14 | 1,750 % éch. 22/01/2049 | 2 200 | 1 775 | 0,22 | 3,290 % éch. 17/03/2026 (f) | 2 200 | 2 143 | 0,27 |
| 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 600 | 765 | 0,10 | 3,250 % éch. 22/01/2044 | 1 700 | 1 910 | 0,24 | Credit Suisse AG AT1 Claim | 1 400 | 168 | 0,02 |
| 9,016 % éch. 15/11/2033 | \$ 1 300 | 1 599 | 0,20 | 4,250 % éch. 07/12/2040 | 1 700 | 2 223 | 0,28 | Doctors Co. An Interinsurance Exchange | | | |
| Total Suisse | | 9 055 | 1,13 | | | 10 943 | 1,37 | 4,500 % éch. 18/01/2032 | 200 | 159 | 0,02 |
| THAÏLANDE | | | | Total Royaume-Uni | | 54 375 | 6,80 | Ford Motor Credit Co. LLC | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉTATS-UNIS | | | | 2,748 % éch. 14/06/2024 | £ 600 | 755 | 0,10 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | 2,900 % éch. 16/02/2028 | \$ 100 | 90 | 0,01 |
| 3,390 % éch. 17/06/2037 THB | 121 650 | 3 777 | 0,47 | Amortizing Residential Collateral Trust | | | | 3,375 % éch. 13/11/2025 | 800 | 766 | 0,10 |
| ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | 6,170 % éch. 25/10/2031 | \$ 2 | 2 | 0,00 | 4,687 % éch. 09/06/2025 | 600 | 590 | 0,07 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Asset-Backed Funding Certificates Trust | | | | GA Global Funding Trust | | | |
| MDGH GMTN RSC Ltd. | | | | 6,170 % éch. 25/06/2034 | 89 | 87 | 0,01 | 2,250 % éch. 06/01/2027 | 600 | 545 | 0,07 |
| 5,500 % éch. 28/04/2033 | \$ 500 | 531 | 0,07 | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | | Goldman Sachs Group, Inc. | | | |
| ROYAUME-UNI | | | | 6,085 % éch. 25/02/2036 | 2 066 | 2 020 | 0,25 | 4,956 % éch. 07/02/2025 | € 1 000 | 1 106 | 0,14 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | JPMorgan Chase & Co. | | | |
| Barclays PLC | | | | 5,790 % éch. 25/12/2036 | 1 691 | 945 | 0,12 | 2,595 % éch. 24/02/2026 | \$ 1 800 | 1 744 | 0,22 |
| 4,375 % éch. 12/01/2026 | 200 | 197 | 0,02 | Countrywide Asset-Backed Certificates | | | | Lehman Brothers Holdings, Inc. | | | |
| 6,224 % éch. 09/05/2034 | 2 300 | 2 387 | 0,30 | 6,150 % éch. 25/12/2036 | 10 | 7 | 0,00 | 0,000 % éch. 16/11/2009 ^ | 700 | 1 | 0,00 |
| Haleon UK Capital PLC | | | | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 5,625 % éch. 24/01/2013 ^ | 600 | 1 | 0,00 |
| 3,125 % éch. 24/03/2025 | 1 200 | 1 172 | 0,15 | 5,610 % éch. 25/06/2037 | 1 173 | 1 083 | 0,14 | 6,200 % éch. 26/09/2014 ^ | 1 400 | 3 | 0,00 |
| HSBC Holdings PLC | | | | 5,610 % éch. 25/07/2037 | 338 | 308 | 0,04 | 7,875 % éch. 08/05/2018 ^ | £ 1 800 | 11 | 0,00 |
| 2,251 % éch. 22/11/2027 | 2 300 | 2 112 | 0,26 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | Morgan Stanley | | | |
| 2,804 % éch. 24/05/2032 | 2 200 | 1 838 | 0,23 | 5,077 % éch. 25/01/2032 | 1 | 1 | 0,00 | 2,630 % éch. 18/02/2026 | \$ 1 300 | 1 259 | 0,16 |
| 2,999 % éch. 10/03/2026 | 500 | 485 | 0,06 | IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | | Organon & Co. | | | |
| | | | | 4,652 % éch. 25/03/2035 | 1 566 | 1 527 | 0,19 | 4,125 % éch. 30/04/2028 | 400 | 369 | 0,05 |
| | | | | Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | Pacific Gas & Electric Co. | | | |
| | | | | 5,770 % éch. 25/05/2036 | 1 094 | 589 | 0,07 | 2,100 % éch. 01/08/2027 | 100 | 90 | 0,01 |
| | | | | Massachusetts Educational Financing Authority | | | | 2,950 % éch. 01/03/2026 | 100 | 95 | 0,01 |
| | | | | 6,590 % éch. 25/04/2038 | 75 | 74 | 0,01 | 3,150 % éch. 01/01/2026 | 100 | 96 | 0,01 |
| | | | | | | | | 3,450 % éch. 01/07/2025 | 100 | 97 | 0,01 |
| | | | | | | | | 3,950 % éch. 01/12/2047 | 100 | 73 | 0,01 |
| | | | | | | | | 4,250 % éch. 15/03/2046 | 300 | 231 | 0,03 |
| | | | | | | | | 4,300 % éch. 15/03/2045 | 100 | 78 | 0,01 |
| | | | | | | | | 4,550 % éch. 01/07/2030 | 200 | 191 | 0,02 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % éch. 10/03/2025 | \$ 1 500 | \$ 1 474 | 0,18 | Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust 5,570 % éch. 25/10/2036 | \$ 3 | \$ 3 | 0,00 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,952 % éch. 25/07/2046 | \$ 76 | \$ 46 | 0,01 |
| Southern California Edison Co. 6,266 % éch. 01/04/2024 | 500 | 500 | 0,06 | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 5,990 % éch. 19/08/2045 | 47 | 40 | 0,01 | | | 18 381 | 2,30 |
| WEA Finance LLC 3,750 % éch. 17/09/2024 | 600 | 589 | 0,07 | 6,110 % éch. 19/07/2045 | 3 | 0 | 0,00 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Wells Fargo & Co. 3,908 % éch. 25/04/2026 | 800 | 785 | 0,10 | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 5,464 % éch. 25/08/2035 | 13 | 9 | 0,00 | Fannie Mae 2,944 % éch. 25/07/2039 | 323 | 294 | 0,04 |
| 4,897 % éch. 25/07/2033 | 1 600 | 1 560 | 0,20 | Greenpoint Mortgage Funding Trust 6,010 % éch. 25/11/2045 | 9 | 8 | 0,00 | 3,000 % éch. 01/03/2060 | 727 | 641 | 0,08 |
| | | 21 431 | 2,68 | GSR Mortgage Loan Trust 6,780 % éch. 25/03/2033 | 3 | 2 | 0,00 | 3,500 % éch. 01/01/2059 | 1 629 | 1 480 | 0,19 |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | HarborView Mortgage Loan Trust 5,862 % éch. 19/12/2036 | 115 | 97 | 0,01 | 5,563 % éch. 25/03/2034 | 2 | 2 | 0,00 |
| CenturyLink, Inc. 7,720 % éch. 15/03/2027 | 812 | 563 | 0,07 | 7,012 % éch. 19/10/2035 | 376 | 205 | 0,03 | 5,593 % éch. 25/08/2034 | 2 | 2 | 0,00 |
| OBLIGATIONS ET BILLETTS MUNICIPAUX | | | | Impac CMB Trust 6,470 % éch. 25/07/2033 | 0 | 0 | 0,00 | 5,620 % éch. 01/12/2034 | 9 | 9 | 0,00 |
| Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021 2,158 % éch. 01/06/2026 | 900 | 840 | 0,10 | IndyMac Mortgage Loan Trust 3,478 % éch. 25/03/2036 | 480 | 337 | 0,04 | 5,765 % éch. 25/03/2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | 4,699 % éch. 25/12/2034 | 8 | 7 | 0,00 | 5,852 % éch. 25/06/2036 | 17 | 16 | 0,00 |
| Adjustable Rate Mortgage Trust 4,820 % éch. 25/09/2035 | 11 | 9 | 0,00 | JPMorgan Alternative Loan Trust 5,500 % éch. 25/11/2036 | 2 | 1 | 0,00 | 5,952 % éch. 25/10/2040 | 35 | 34 | 0,00 |
| American Home Mortgage Assets Trust 5,660 % éch. 25/05/2046 | 182 | 151 | 0,02 | 5,950 % éch. 25/10/2036 | 243 | 216 | 0,03 | 6,000 % éch. 25/04/2043 - 25/07/2044 | 76 | 76 | 0,01 |
| 5,952 % éch. 25/10/2046 | 843 | 574 | 0,07 | JPMorgan Mortgage Trust 3,750 % éch. 27/07/2037 | 157 | 144 | 0,02 | 6,021 % éch. 01/11/2034 | 38 | 39 | 0,00 |
| Banc of America Funding Trust 4,443 % éch. 20/10/2046 | 78 | 64 | 0,01 | 4,704 % éch. 25/02/2036 | 85 | 58 | 0,01 | 6,129 % éch. 01/09/2044 | 37 | 35 | 0,00 |
| 5,061 % éch. 20/01/2047 | 34 | 29 | 0,00 | 4,735 % éch. 25/11/2033 | 4 | 4 | 0,00 | Freddie Mac 0,000 % éch. 15/01/2038 (a) | 254 | 13 | 0,00 |
| 5,792 % éch. 20/02/2047 | 632 | 545 | 0,07 | Madison Avenue Mortgage Trust 3,555 % éch. 10/09/2035 | 868 | 782 | 0,10 | 5,334 % éch. 15/01/2038 | 254 | 250 | 0,03 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,877 % éch. 25/05/2047 | 123 | 111 | 0,01 | MASTR Alternative Loan Trust 5,870 % éch. 25/03/2036 | 87 | 10 | 0,00 | 6,021 % éch. 01/09/2035 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,091 % éch. 25/05/2034 | 11 | 9 | 0,00 | Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass- Through Trust 5,916 % éch. 15/12/2030 | 8 | 8 | 0,00 | 6,053 % éch. 15/12/2037 - 15/07/2040 | 111 | 111 | 0,01 |
| 4,393 % éch. 25/08/2033 | 4 | 4 | 0,00 | Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust 5,690 % éch. 25/03/2037 | 5 979 | 1 473 | 0,18 | 6,212 % éch. 25/10/2044 - 25/02/2045 | 159 | 146 | 0,02 |
| 5,611 % éch. 25/10/2033 | 6 | 5 | 0,00 | Residential Accredited Loans, Inc. Trust 5,620 % éch. 25/02/2047 | 164 | 59 | 0,01 | 6,452 % éch. 25/05/2043 | 18 | 19 | 0,00 |
| Bear Stearns ALT-A Trust 4,492 % éch. 25/11/2036 | 365 | 190 | 0,02 | 5,770 % éch. 25/06/2037 | 277 | 257 | 0,03 | Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/07/2046 - 20/05/2047 | 20 | 19 | 0,00 |
| 4,600 % éch. 25/11/2035 | 90 | 68 | 0,01 | 5,790 % éch. 25/03/2047 | 676 | 599 | 0,08 | Ginnie Mae, TBA 3,000 % éch. 01/02/2054 | 5 000 | 4 531 | 0,57 |
| 4,730 % éch. 25/09/2035 | 238 | 141 | 0,02 | 5,830 % éch. 25/07/2036 | 1 093 | 441 | 0,06 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 3,993 % éch. 26/12/2046 | 350 | 264 | 0,03 | 5,830 % éch. 25/06/2046 | 792 | 188 | 0,02 | 2,500 % éch. 01/02/2051 - 01/01/2052 | 2 689 | 2 292 | 0,29 |
| Chase Mortgage Finance Trust 4,523 % éch. 25/07/2037 | 41 | 32 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/06/2036 | 344 | 265 | 0,03 | 3,000 % éch. 01/04/2043 - 01/06/2051 | 1 835 | 1 646 | 0,21 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust 4,523 % éch. 25/09/2037 | 222 | 196 | 0,02 | 6,270 % éch. 25/10/2045 | 62 | 50 | 0,01 | 3,500 % éch. 01/10/2034 - 01/07/2050 | 1 405 | 1 322 | 0,17 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,252 % éch. 25/08/2035 | 221 | 204 | 0,03 | 6,288 % éch. 25/11/2037 | 672 | 549 | 0,07 | 4,000 % éch. 01/06/2050 | 676 | 646 | 0,08 |
| 5,972 % éch. 25/09/2035 | 15 | 15 | 0,00 | Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 5,091 % éch. 25/09/2035 | 37 | 25 | 0,00 | 4,500 % éch. 01/03/2053 | 23 718 | 23 007 | 2,88 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass- Through Certificates 4,150 % éch. 25/09/2035 | 293 | 259 | 0,03 | 6,500 % éch. 25/03/2032 | 0 | 0 | 0,00 | 5,500 % éch. 01/06/2053 | 21 170 | 21 270 | 2,66 |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust 6,000 % éch. 25/02/2037 | 1 813 | 1 524 | 0,19 | Sequoia Mortgage Trust 3,917 % éch. 20/07/2037 | 438 | 323 | 0,04 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| Countrywide Alternative Loan Trust 4,174 % éch. 25/02/2037 | 100 | 87 | 0,01 | 6,172 % éch. 20/07/2033 | 11 | 10 | 0,00 | 4,000 % éch. 01/01/2054 | 29 100 | 27 532 | 3,44 |
| 5,250 % éch. 25/06/2035 | 17 | 13 | 0,00 | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 6,478 % éch. 25/02/2034 | 10 | 9 | 0,00 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 18 300 | 17 752 | 2,22 |
| 5,652 % éch. 20/02/2047 | 691 | 533 | 0,07 | 6,624 % éch. 25/04/2034 | 6 | 6 | 0,00 | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 36 400 | 36 019 | 4,50 |
| 5,682 % éch. 20/07/2046 | 167 | 134 | 0,02 | Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,790 % éch. 25/01/2037 | 997 | 877 | 0,11 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 7 500 | 7 534 | 0,94 |
| 5,820 % éch. 25/05/2037 | 66 | 23 | 0,00 | 5,850 % éch. 25/07/2046 | 316 | 222 | 0,03 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 43 500 | 44 171 | 5,52 |
| 6,000 % éch. 25/07/2037 | 1 991 | 984 | 0,12 | 5,890 % éch. 25/05/2036 | 129 | 87 | 0,01 | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 76 600 | 78 494 | 9,80 |
| 6,250 % éch. 25/08/2037 | 51 | 25 | 0,00 | 5,910 % éch. 25/05/2036 | 609 | 479 | 0,06 | | | 269 406 | 33,66 |
| 6,500 % éch. 25/06/2036 | 152 | 73 | 0,01 | 6,050 % éch. 19/07/2034 | 5 | 4 | 0,00 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| 6,512 % éch. 25/11/2035 | 55 | 47 | 0,01 | 6,170 % éch. 19/03/2034 | 2 | 2 | 0,00 | Obligations du Trésor américain | | | |
| 7,010 % éch. 25/11/2035 | 122 | 99 | 0,01 | Structured Asset Securities Corp. 5,750 % éch. 25/01/2036 | 158 | 130 | 0,02 | 1,625 % éch. 15/11/2050 | 400 | 239 | 0,03 |
| 7,052 % éch. 25/11/2035 | 22 | 19 | 0,00 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,760 % éch. 25/10/2036 | 445 | 358 | 0,05 | 4,000 % éch. 15/11/2052 | 200 | 197 | 0,03 |
| 7,062 % éch. 20/10/2035 | 1 085 | 763 | 0,10 | Thornburg Mortgage Securities Trust 6,815 % éch. 25/06/2047 | 81 | 71 | 0,01 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) | | | |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,765 % éch. 25/11/2034 | 4 | 4 | 0,00 | Wachovia Mortgage Loan Trust 1,850 % éch. 25/01/2037 | 1 404 | 516 | 0,07 | 0,125 % éch. 15/04/2025 | 5 658 | 5 456 | 0,68 |
| 5,930 % éch. 25/05/2035 | 19 | 15 | 0,00 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,787 % éch. 25/02/2037 | 624 | 567 | 0,07 | 0,125 % éch. 15/07/2031 | 2 985 | 2 655 | 0,33 |
| 6,000 % éch. 25/02/2037 | 893 | 425 | 0,05 | 3,834 % éch. 25/06/2037 | 100 | 85 | 0,01 | 0,125 % éch. 15/01/2032 | 1 221 | 1 073 | 0,13 |
| 6,110 % éch. 25/03/2035 | 90 | 80 | 0,01 | 3,847 % éch. 25/05/2037 | 333 | 284 | 0,04 | 0,250 % éch. 15/01/2025 | 8 444 | 8 196 | 1,03 |
| 6,130 % éch. 25/02/2035 | 45 | 41 | 0,01 | 4,172 % éch. 25/09/2036 | 129 | 110 | 0,01 | 0,500 % éch. 15/01/2028 | 6 611 | 6 258 | 0,78 |
| 6,230 % éch. 25/09/2034 | 4 | 4 | 0,00 | 4,335 % éch. 27/02/2034 | 6 | 6 | 0,00 | 0,625 % éch. 15/07/2032 | 424 | 387 | 0,05 |
| Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,810 % éch. 25/06/2035 | 89 | 84 | 0,01 | 4,379 % éch. 25/03/2034 | 1 | 1 | 0,00 | 1,125 % éch. 15/01/2033 | 5 474 | 5 183 | 0,65 |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 5,710 % éch. 25/08/2036 | 363 | 332 | 0,04 | 6,012 % éch. 25/02/2046 | 181 | 159 | 0,02 | 1,750 % éch. 15/01/2028 | 587 | 584 | 0,07 |
| | | | | 6,090 % éch. 25/01/2045 | 13 | 13 | 0,00 | 2,375 % éch. 15/01/2025 | 1 469 | 1 458 | 0,18 |
| | | | | | | | | 2,375 % éch. 15/01/2027 | 763 | 770 | 0,10 |
| | | | | | | | | 2,500 % éch. 15/01/2029 | 5 159 | 5 335 | 0,67 |
| | | | | | | | | 3,875 % éch. 15/04/2029 | 1 684 | 1 857 | 0,23 |
| | | | | | | | | Billets du Trésor américain | | | |
| | | | | | | | | 3,500 % éch. 15/02/2033 | 600 | 582 | 0,07 |
| | | | | | | | | | | 40 230 | 5,03 |
| | | | | | | | | Total États-Unis | | | |
| | | | | | | | | | | 371 735 | 46,45 |
| | | | | | | | | INSTRUMENTS A COURT TERME BILLETTS DE TRÉSORERIE | | | |
| | | | | | | | | AT+T, Inc. 5,700 % éch. 19/03/2024 | 2 750 | 2 715 | 0,34 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.IG-40 Index à 10 ans | (1,000) % | 20/06/2033 | \$ 6 600 | \$ (118) | (0,01) |
| Indice CDX.IG-41 Index à 10 ans | (1,000) | 20/12/2033 | 82 000 | (928) | (0,12) |
| Indice iTraxx Europe Main 40 Index à 10 ans | (1,000) | 20/12/2033 | € 5 400 | (77) | (0,01) |
| | | | | \$ (1 123) | (0,14) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.IG-40 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/06/2028 | \$ 1 000 | \$ 6 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 117 400 | 843 | 0,11 |
| | | | | \$ 849 | 0,11 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-----------------------------------|--------------|--------------------|----------------------|---|------------------------|
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,000 % | 17/06/2027 | £ 21 900 | \$ 52 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 17/06/2035 | 4 700 | (10) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 2 800 | 448 | 0,06 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 40 900 | 4 305 | 0,54 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 41 600 | 1 415 | 0,18 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 12 000 | 310 | 0,04 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,250 | 20/03/2029 | INR 501 570 | 7 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2029 | 162 160 | 6 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2034 | 103 220 | (7) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/12/2026 | ¥ 970 000 | 1 | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/12/2028 | 10 000 | (1) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 17/03/2031 | 610 000 | (161) | (0,02) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,050 | 15/12/2031 | 851 000 | (101) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 19/06/2039 | 540 000 | 484 | 0,06 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/12/2051 | 80 000 | (123) | (0,02) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,450 | 15/12/2051 | 170 000 | (56) | (0,01) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,800 | 15/06/2052 | 640 000 | (340) | (0,04) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,850 | 20/09/2033 | 120 000 | (9) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,200 | 20/09/2053 | 290 000 | 79 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 20/03/2029 | SGD 21 489 | (160) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/01/2028 | \$ 24 600 | (2 139) | (0,27) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 16/06/2031 | 15 710 | 1 868 | 0,23 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2027 | 16 900 | 1 236 | 0,15 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2029 | 26 260 | (1 864) | (0,23) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,249 | 31/08/2024 | 11 650 | 570 | 0,07 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/12/2026 | 63 400 | 5 811 | 0,73 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,298 | 25/08/2024 | 10 200 | 511 | 0,06 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 19 300 | (2 314) | (0,29) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,518 | 20/01/2029 | 1 500 | (161) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 20/01/2029 | 4 400 | (447) | (0,06) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2024 | 9 600 | 113 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2027 | 21 830 | 22 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 800 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 1 700 | (23) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 1 900 | (29) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,965 | 30/06/2024 | 15 900 | (374) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,965 | 30/11/2026 | 27 900 | 680 | 0,08 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,968 | 30/06/2024 | 15 900 | (373) | (0,05) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 1 100 | (15) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | 700 | (10) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 800 | (11) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 08/09/2029 | 500 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 500 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100 | 09/09/2029 | 2 100 | (45) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 900 | (10) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,150 | 13/05/2025 | 56 600 | 397 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 800 | (9) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,200 | 13/05/2025 | 4 600 | 43 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 900 | (10) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 30/09/2029 | 2 800 | (56) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 4 800 | 49 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/12/2053 | 20 590 | (2 474) | (0,31) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,454 | 30/06/2029 | 5 400 | (68) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 1 100 | (14) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/06/2030 | 1 800 | (10) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 200 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 60 942 | 2 685 | 0,33 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 700 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 1 500 | (14) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notional | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 % | 05/12/2024 | \$ 1 900 | \$ (17) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 500 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 3 000 | (24) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 1 400 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 14 800 | 208 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 33 097 | (871) | (0,11) |
| À payer ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2034 | 5 390 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 500 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 1 100 | (30) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,849 | 31/03/2030 | 700 | 11 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 1 600 | (45) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,857 | 31/03/2030 | 3 600 | 53 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,898 | 30/06/2029 | 5 000 | 58 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,951 | 31/03/2030 | 8 500 | 179 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,981 | 30/11/2027 | 13 300 | 159 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,988 | 30/11/2027 | 10 600 | 274 | 0,03 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,000 | 20/03/2054 | 3 200 | (58) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,159 | 31/03/2025 | 35 100 | 513 | 0,06 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,193 | 30/11/2027 | 9 100 | 182 | 0,02 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,228 | 30/08/2025 | 11 700 | (50) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 119 651 | (547) | (0,07) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 04/10/2025 | 2 900 | (27) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,220 | 03/03/2025 | CAD 6 900 | (297) | (0,04) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2025 | 9 600 | (331) | (0,04) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2030 | 9 200 | (580) | (0,07) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 16/06/2051 | 250 | (27) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,713 | 02/10/2029 | 2 100 | (140) | (0,02) |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,900 | 18/12/2029 | 24 500 | (1 612) | (0,20) |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 3,250 | 15/03/2028 | 9 640 | 165 | 0,02 |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 3,250 | 15/03/2033 | 4 900 | 66 | 0,01 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 21/06/2033 | 4 600 | 126 | 0,02 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 21/06/2053 | 2 300 | 215 | 0,03 |
| À payer ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 10/05/2025 | 78 600 | (125) | (0,02) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 01/06/2032 | 5 700 | (104) | (0,01) |
| À recevoir | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2033 | 9 000 | (344) | (0,04) |
| À payer ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,600 | 30/08/2025 | 14 600 | 104 | 0,01 |
| À payer ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 5,000 | 04/10/2025 | 4 000 | 43 | 0,01 |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,283 | 14/02/2027 | CHF 900 | (39) | (0,01) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,294 | 10/02/2027 | 8 500 | (344) | (0,04) |
| À payer | SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois | 0,343 | 16/05/2027 | 1 900 | (75) | (0,01) |
| À payer ⁽⁴⁾ | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | CNY 286 920 | 229 | 0,03 |
| À payer ⁽⁴⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,250 | 20/03/2029 | KRW 2 155 640 | 8 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,500 | 20/03/2034 | 1 749 240 | 12 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 0,528 | 17/03/2024 | NZD 650 | (2) | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 3,750 | 15/06/2027 | 9 400 | 7 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 4,000 | 14/06/2024 | 32 500 | (95) | (0,01) |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR NZD à 3 mois | 4,750 | 20/03/2025 | 22 600 | (28) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR NZD à 3 mois | 5,000 | 20/03/2025 | 24 900 | 29 | 0,00 |
| À payer | STIBOR SEK à 3 mois | 0,500 | 19/06/2024 | SEK 56 200 | (155) | (0,02) |
| À recevoir | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,250 | 17/06/2030 | AUD 5 100 | 417 | 0,05 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 1,750 | 16/03/2027 | 6 600 | (311) | (0,04) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,000 | 21/06/2033 | 27 900 | 270 | 0,03 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 15/09/2032 | 1 900 | 0 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 15/03/2033 | 14 500 | (204) | (0,03) |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 15/09/2032 | 43 700 | 303 | 0,04 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | 65 300 | 985 | 0,12 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,913 | 30/01/2029 | CZK 24 300 | (100) | (0,01) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,054 | 27/05/2050 | € 450 | 117 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,064 | 17/11/2052 | 1 000 | 336 | 0,04 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | 900 | (30) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | 2 400 | (155) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 1 800 | (108) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 1 400 | (88) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 2 200 | (109) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 1 300 | (64) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | 6 500 | 17 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 14 700 | 43 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 4 000 | 12 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 26/04/2024 | 1 600 | 9 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 2 200 | 10 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 2 100 | 10 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 21/09/2037 | 8 950 | (535) | (0,07) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 21/09/2042 | 1 260 | (162) | (0,02) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 26 700 | (3 073) | (0,38) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 800 | (12) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 2 100 | (43) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 700 | (24) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 1 000 | (37) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 700 | (15) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 1 700 | (42) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 300 | (13) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 19/03/2027 | 30 530 | 388 | 0,05 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 % | 15/03/2033 | € 13 460 | \$ (181) | (0,02) |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 87 520 | 5 230 | 0,65 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 200 | (10) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 112 620 | 4 379 | 0,55 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 1 800 | (68) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 500 | (35) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 900 | 70 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 800 | (58) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 2 900 | 133 | 0,02 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 109 700 | 1 585 | 0,20 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,536 | 18/09/2025 | 9 900 | (104) | (0,01) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 1,500 | 20/03/2024 | HUF 342 600 | (35) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 4,870 | 07/07/2025 | MXN 86 100 | (173) | (0,02) |
| | | | | | \$ 14 808 | 1,85 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 14 532 | 1,82 |

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 % | 15/07/2024 | 14 100 | \$ 28 | \$ 10 | 0,00 |
| | | | À recevoir | 2,180 | 11/01/2024 | 3 600 | 103 | 385 | 0,05 |
| BRC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 23 000 | 31 | 1 | 0,00 |
| DUB | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,750 | 10/07/2024 | 66 800 | 182 | 47 | 0,01 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 43 400 | 67 | 1 | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 25 800 | 33 | 1 | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/03/2024 | 24 100 | 33 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ 477 | \$ 446 | 0,06 |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BPS | Option de vente - Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052 hors cote | € 97,000 | 23/05/2025 | 1 600 | \$ 121 | \$ 657 | 0,08 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM | Option de vente - USD contre TWD hors cote | TWD 31,000 | 04/03/2024 | 1 055 | \$ (14) | \$ (31) | (0,01) |
| JPM | Option de vente - USD contre TWD hors cote | 31,000 | 01/03/2024 | 2 801 | (38) | (80) | (0,01) |
| | | | | | \$ (52) | \$ (111) | (0,02) |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,310 % | 11/01/2024 | 31 500 | \$ (102) | \$ (730) | (0,09) |
| | | | À payer | 5,250 | 15/07/2024 | 14 100 | (14) | (4) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 800 | (4) | (10) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 800 | (4) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 0,451 | 23/05/2025 | 1 600 | (121) | (607) | (0,08) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 0,451 | 23/05/2025 | 1 600 | (121) | (607) | (0,08) |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 % | 18/01/2024 | 600 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 600 | (2) | (2) | 0,00 |
| DUB | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,790 | 08/04/2024 | 2 800 | (22) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,790 | 08/04/2024 | 2 800 | (22) | (42) | (0,01) |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 5,250 | 10/07/2024 | 66 800 | (100) | (16) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 3 400 | (27) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 3 400 | (27) | (54) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 | 08/04/2024 | 900 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 900 | (7) | (14) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 600 | (3) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 600 | (3) | (8) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 600 | (3) | (10) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 600 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 600 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR GBP à 6 mois | À recevoir | 0,820 | 16/12/2024 | 8 700 | (62) | (10) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 550 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 650 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 500 | (2) | (8) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 700 | (3) | (13) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 550 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 650 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 500 | (2) | 0 | 0,00 |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 700 | (3) | 0 | 0,00 | |
| | | | | | | | \$ (564) | \$ (1 550) | (0,19) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--------------|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|--------|
| GST | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 2 000 | \$ (59) | \$ (8) | \$ (67) | (0,01) | |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement sud-coréen | (1,000) | 20/12/2028 | 1 900 | (54) | (10) | (64) | (0,01) | |
| | | | | | | \$ (113) | \$ (18) | \$ (131) | (0,02) |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|------|
| BRC | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 % | 20/06/2025 | \$ 1 500 | \$ (37) | \$ 54 | \$ 17 | 0,00 | |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 | 20/06/2025 | 1 000 | (24) | 36 | 12 | 0,00 | |
| | | | | | | \$ (61) | \$ 90 | \$ 29 | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽³⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|--|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| AZD | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,290 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 04/01/2031 | AUD 5 900 | \$ 4 445 | \$ 29 | \$ (12) | \$ 17 | 0,00 |
| CBK | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,420 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 31/07/2029 | 7 100 | 4 899 | (2) | 23 | 21 | 0,01 |

| Contrepartie | À recevoir | À payer | Date d'échéance | Montant notionnel de la devise reçue | Montant notionnel de la devise livrée | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--------------|--|--|-----------------|--------------------------------------|---------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|------|
| GLM | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,423 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 01/08/2029 | AUD 7 000 | \$ 4 830 | \$ (14) | \$ 23 | \$ 9 | 0,00 | |
| MYC | Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,298 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue | Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notionnel de la devise livrée | 14/10/2030 | | 2 000 | 1 437 | 9 | (3) | 6 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 22 | \$ 31 | \$ 53 | 0,01 | |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 % | 20/09/2028 | MYR 11 550 | \$ 61 | \$ (53) | \$ 8 | 0,00 |
| GST | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/09/2028 | 57 380 | 227 | (189) | 38 | 0,01 |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,600 | 20/09/2028 | 40 670 | (4) | (8) | (12) | 0,00 |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,750 | 20/09/2033 | 11 320 | 72 | (54) | 18 | 0,00 |
| | | | | | | \$ 356 | \$ (304) | \$ 52 | 0,01 |

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--|----------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS | À recevoir | Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | S/O | 1,113 % | \$ 18 800 | 20/03/2024 | \$ 227 | \$ (1 387) | \$ (1 160) | (0,14) |
| JPM | À recevoir | Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | S/O | 1,113 | 5 300 | 20/03/2024 | 66 | (434) | (368) | (0,05) |
| MYC | À recevoir | Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | S/O | 1,113 | 1 700 | 20/03/2024 | 20 | (105) | (85) | (0,01) |
| | | | | | | | \$ 313 | \$ (1 926) | \$ (1 613) | (0,20) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 13 850 | \$ 9 174 | \$ 0 | \$ (278) | (0,03) |
| | 03/2024 | CNH | 43 275 | 6 004 | 0 | (108) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | £ | 2 237 | 2 836 | 0 | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 4 319 979 | 29 274 | 0 | (1 388) | (0,17) |
| | 01/2024 | NZD | 2 389 | 1 456 | 0 | (57) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 242 | NOK 2 569 | 11 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 67 820 | \$ 9 366 | 0 | (213) | (0,03) |
| | 03/2024 | IDR | 3 531 433 | 225 | 0 | (4) | 0,00 |
| BPS | 06/2024 | KRW | 194 402 | 149 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK | 48 773 | 7 194 | 0 | (35) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 10 064 | 10 981 | 0 | (139) | (0,02) |
| | 01/2024 | £ | 4 741 | 6 014 | 0 | (30) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 201 260 | 574 | 0 | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 2 651 496 | 18 091 | 0 | (729) | (0,09) |
| | 01/2024 | KRW | 197 067 | 150 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 100 | BRL 491 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 383 | CAD 3 225 | 63 | 0 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 10 883 | € 9 956 | 118 | (1) | 0,01 |
| | 01/2024 | | 3 | HUF 901 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 150 | IDR 2 319 926 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 13 442 | ¥ 1 978 700 | 602 | 0 | 0,08 |
| | 01/2024 | | 3 661 | ZAR 67 871 | 45 | 0 | 0,01 |
| | 02/2024 | TWD | 74 676 | \$ 2 349 | 0 | (119) | (0,02) |
| | 03/2024 | CNH | 91 502 | 12 710 | 0 | (214) | (0,03) |
| | 03/2024 | IDR | 8 037 182 | 524 | 3 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | INR | 175 655 | 2 105 | 2 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 115 492 | 3 676 | 0 | (151) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ | 490 | CNH 3 539 | 10 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 2 674 | IDR 42 034 861 | 52 | 0 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 61 | THB 2 122 | 2 | 0 | 0,00 |
| BRC | 06/2024 | KRW | 10 662 748 | \$ 8 167 | 0 | (133) | (0,02) |
| | 01/2024 | ¥ | 1 290 000 | 8 820 | 0 | (346) | (0,04) |
| | 01/2024 | KRW | 193 845 | 150 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 917 | € 839 | 10 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 100 | MXN 1 705 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 149 | ZAR 2 773 | 3 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | THB | 51 | \$ 1 | 0 | 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | \$ 50 | IDR 776 911 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | ¥ 690 018 | \$ 5 644 | 683 | 0 | 683 | 0,09 |
| | 05/2024 | 310 000 | 2 507 | 269 | 0 | 269 | 0,03 |
| CBK | 06/2024 | KRW 11 037 302 | 8 464 | 0 | (127) | (127) | (0,02) |
| | 01/2024 | BRL 28 305 | 5 813 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF 3 426 | 3 949 | 0 | (124) | (124) | (0,02) |
| | 01/2024 | DKK 3 775 | 552 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 8 405 | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR 2 314 281 | 150 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 709 600 | 5 026 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 056 | AUD 1 570 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 192 | DKK 8 235 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 090 | £ 1 660 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 887 | MXN 51 056 | 115 | 0 | 115 | 0,01 |
| | 01/2024 | 387 | PLN 1 553 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 35 246 | \$ 4 968 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS 7 739 | 2 126 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN 3 539 | 940 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 1 197 | BRL 5 928 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 03/2024 | 870 | CNH 6 295 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 03/2024 | 150 | IDR 2 314 875 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | 5 813 | BRL 28 592 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| DUB | 06/2024 | KRW 1 875 289 | \$ 1 455 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | 129 970 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 31 511 | 4 373 | 0 | (78) | (78) | (0,01) |
| | 03/2024 | SGD 2 686 | 2 029 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| GLM | 06/2024 | KRW 11 157 417 | 8 572 | 0 | (113) | (113) | (0,01) |
| | 01/2024 | CAD 23 335 | 17 172 | 0 | (528) | (528) | (0,07) |
| | 01/2024 | DKK 64 615 | 9 531 | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ 2 245 500 | 15 952 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 12 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 573 | BRL 28 073 | 207 | 0 | 207 | 0,03 |
| | 01/2024 | 924 | £ 725 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 5 366 | MXN 94 131 | 167 | 0 | 167 | 0,02 |
| | 01/2024 | 2 250 | PLN 9 011 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH 47 275 | \$ 6 545 | 0 | (133) | (133) | (0,02) |
| | 03/2024 | IDR 39 278 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD 343 | 259 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 175 | IDR 2 692 063 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | 03/2024 | 564 | TWD 17 475 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 459 463 | \$ 1 308 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 150 | IDR 2 308 050 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 150 | KRW 194 424 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 834 | BRL 4 091 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 02/2024 | 11 119 | INR 928 889 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 10 774 363 | \$ 695 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 119 653 | 3 848 | 0 | (116) | (116) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 2 186 | TWD 67 683 | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| | 06/2024 | KRW 11 404 015 | \$ 8 787 | 1 | (91) | (90) | (0,01) |
| MBC | 10/2024 | ¥ 330 000 | 2 646 | 212 | 0 | 212 | 0,03 |
| | 01/2024 | AUD 7 382 | 4 894 | 0 | (144) | (144) | (0,02) |
| | 01/2024 | CAD 2 025 | 1 496 | 0 | (40) | (40) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ 2 317 100 | 16 258 | 0 | (188) | (188) | (0,02) |
| | 01/2024 | MXN 513 | 28 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 056 | AUD 3 035 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 668 | € 4 279 | 59 | 0 | 59 | 0,01 |
| | 01/2024 | 121 | HUF 44 333 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 4 100 000 | \$ 27 716 | 0 | (1 544) | (1 544) | (0,19) |
| | 03/2024 | CNH 3 514 | 485 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ 620 016 | 5 070 | 634 | 0 | 634 | 0,08 |
| | 03/2024 | \$ 632 | CNH 4 487 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 10/2024 | ¥ 730 000 | \$ 5 853 | 468 | 0 | 468 | 0,06 |
| | 01/2024 | CAD 1 896 | 1 438 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK 2 710 | 401 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 29 555 | 84 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 1 641 010 | 11 131 | 0 | (517) | (517) | (0,06) |
| | 01/2024 | MYR 1 783 | 382 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 12 | € 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 41 296 | \$ 5 726 | 0 | (106) | (106) | (0,01) |
| | 03/2024 | ¥ 5 210 000 | 35 811 | 0 | (1 528) | (1 528) | (0,19) |
| | 03/2024 | THB 13 620 | 398 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 483 | CNH 3 436 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 912 | IDR 44 962 124 | 7 | (4) | 3 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 6 424 754 | \$ 4 940 | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| RBC | 10/2024 | ¥ 260 000 | 2 126 | 208 | 0 | 208 | 0,03 |
| | 04/2024 | \$ 8 | MXN 137 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | AUD 987 | \$ 664 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 04/2024 | DKK 7 300 | 1 096 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | MYR 44 252 | 9 474 | 0 | (183) | (183) | (0,02) |
| | 03/2024 | CNH 40 542 | 5 600 | 0 | (126) | (126) | (0,02) |
| | 03/2024 | IDR 1 577 776 | 100 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 117 860 | 3 410 | 0 | (66) | (66) | (0,01) |
| | 03/2024 | TWD 124 229 | 3 986 | 0 | (130) | (130) | (0,02) |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | \$ 212 | IDR 3 310 448 | \$ 3 | \$ (1) | \$ 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 092 | TWD 65 082 | 64 | 0 | 64 | 0,01 |
| SOG | 06/2024 | KRW 5 322 282 | \$ 4 100 | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH 2 785 | 384 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 396 | CNH 2 873 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SSB | 03/2024 | 479 | IDR 7 547 172 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| TOR | 02/2024 | ¥ 3 810 000 | \$ 25 747 | 0 | (1 409) | (1 409) | (0,18) |
| | 03/2024 | CNH 21 314 | 2 952 | 0 | (58) | (58) | (0,01) |
| UAG | 03/2024 | IDR 780 507 | 49 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD 4 560 | 3 026 | 0 | (87) | (87) | (0,01) |
| | 01/2024 | CAD 8 681 | 6 400 | 0 | (184) | (184) | (0,02) |
| | 01/2024 | € 123 307 | 135 633 | 0 | (609) | (609) | (0,08) |
| | 01/2024 | £ 25 759 | 32 599 | 0 | (240) | (240) | (0,03) |
| | 01/2024 | ¥ 172 886 | 1 180 | 0 | (47) | (47) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN 3 545 | 200 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 340 | NOK 14 290 | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| | 01/2024 | 653 | ZAR 12 472 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | | | | \$ 4 444 | \$ (12 850) | \$ (8 406) | (1,05) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 193 | \$ 214 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 999 | € 915 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € 6 | \$ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 | € 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 21 | \$ 23 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 8 039 | € 7 312 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 8 064 | 7 337 | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 7 557 | 6 870 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | | | | \$ 129 | \$ (1) | \$ 128 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en USD (exposition au risque de change) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 652 | AUD 984 | \$ 20 | \$ 0 | \$ 20 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | PEN 278 | \$ 75 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 345 | AUD 522 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 01/2024 | 235 | £ 186 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 982 | ¥ 735 162 | 237 | 0 | 237 | 0,03 |
| | 01/2024 | 190 | NZD 312 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | 75 | PEN 278 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 75 | 278 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 58 | \$ 63 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 96 | DKK 653 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 528 | € 484 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | 562 | £ 443 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | 217 | ¥ 31 974 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 8 462 | 59 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 422 | IDR 6 573 507 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 367 | THB 12 894 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | DKK 1 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 159 | 175 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 5 926 | 350 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 204 | CNY 1 446 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 162 | KRW 1 497 492 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | 20 | NOK 209 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 | SEK 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 348 | MXN 5 926 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | 14 | SGD 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CLP 38 146 | \$ 43 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR 1 559 | 335 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 482 | CAD 3 372 | 76 | 0 | 76 | 0,01 |
| | 01/2024 | 538 | CHF 472 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 01/2024 | 8 635 | CNY 60 986 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | 161 | CZK 3 570 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 66 | HUF 23 188 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 107 | ILS 400 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 335 | MYR 1 559 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 198 | PLN 792 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 02/2024 | 43 | CLP 38 146 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | 336 | MYR 1 559 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| MBC | 01/2024 | CNY 314 | \$ 44 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 51 | 55 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 7 522 | 53 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 306 | AUD 462 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | 76 | CAD 102 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 43 | CLP 38 146 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 16 485 | € 14 993 | 81 | 0 | 81 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 344 | MXN 5 926 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 61 | CAD 80 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 357 | € 3 964 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| | 01/2024 | 1 894 | ¥ 279 262 | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | 197 | SGD 262 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | CNY 1 065 | \$ 150 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | TWD 470 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 240 | CNY 1 706 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 349 | SEK 3 628 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 1 221 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | \$ 3 131 | ¥ 459 250 | 130 | 0 | 130 | 0,02 |
| UAG | 01/2024 | 0 | CZK 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 127 | DKK 866 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 047 | £ 2 408 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| | 01/2024 | 88 | NOK 934 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 10 | PLN 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 810 | \$ (41) | \$ 769 | 0,10 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (9 677) (1,21)

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 2,000 % éch. 01/01/2039 | \$ 13 300 | \$ (11 926) | (1,49) |
| 2,000 % éch. 01/02/2054 | 75 650 | (61 915) | (7,73) |
| 2,500 % éch. 01/02/2054 | 3 300 | (2 812) | (0,35) |
| 3,000 % éch. 01/02/2054 | 7 400 | (6 554) | (0,82) |
| 5,500 % éch. 01/01/2054 | 14 700 | (14 764) | (1,85) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (97 971) | (12,24) |
| Total des Investissements | | \$ 875 723 | 109,45 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (75 597) | (9,45) |
| Actifs nets | | \$ 800 126 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,76 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Citigroup, Inc. | 3,290 % | 17/03/2026 | 10/03/2022 | \$ 2 200 | \$ 2 143 | 0,27 |
| Deutsche Bank AG | 3,729 | 14/01/2032 | 22/01/2021 | 301 | 251 | 0,03 |
| | | | | \$ 2 501 | \$ 2 394 | 0,30 |

Un montant en numéraire de 28 089 \$ (31 décembre 2022 : 25 647 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 10 080 \$ (31 décembre 2022 : 12 800 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 962 859 | \$ 93 | \$ 962 952 |
| Fonds d'investissement | 10 172 | 0 | 0 | 10 172 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 005 | 0 | 1 005 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (1 720) | 1 285 | 0 | (435) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (97 971) | 0 | (97 971) |
| Totaux | \$ 8 452 | \$ 867 178 | \$ 93 | \$ 875 723 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 737 412 | \$ 0 | \$ 737 412 |
| Fonds d'investissement | 46 863 | 459 | 0 | 47 322 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 625 | 0 | 1 625 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 1 705 | (29 777) | 0 | (28 072) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (76 200) | 0 | (76 200) |
| Totaux | \$ 48 568 | \$ 633 519 | \$ 0 | \$ 682 087 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (349) | \$ 300 | \$ (49) | \$ 27 | \$ 0 | \$ 27 |
| BOA | (1 743) | 1 570 | (173) | (4 371) | 3 760 | (611) |
| BOM | S/O | S/O | S/O | (9) | 0 | (9) |
| BPS | (1 750) | 1 990 | 240 | 633 | (530) | 103 |
| BRC | 524 | (450) | 74 | 488 | (400) | 88 |
| CBK | 60 | 0 | 60 | 979 | (680) | 299 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (11) | 0 | (11) |
| DUB | (217) | 0 | (217) | (252) | 280 | 28 |
| GLM | (324) | 0 | (324) | (593) | 420 | (173) |
| GST | (23) | 0 | (23) | (35) | 0 | (35) |
| HUS | S/O | S/O | S/O | (5) | 0 | (5) |
| IND | S/O | S/O | S/O | 193 | (330) | (137) |
| JPM | (399) | 260 | (139) | 165 | 0 | 165 |
| MBC | (612) | 620 | 8 | (4 349) | 3 720 | (629) |
| MYC | (170) | 10 | (160) | 15 | 10 | 25 |
| MYI | (1 858) | 1 890 | 32 | (894) | 490 | (404) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (1) | 0 | (1) |
| RYL | S/O | S/O | S/O | (3) | 0 | (3) |
| SCX | (472) | 340 | (132) | (688) | 600 | (88) |
| SOG | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |
| SSB | 10 | 0 | 10 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (1 338) | 1 280 | (58) | (3 747) | 3 130 | (617) |
| UAG | (1 017) | 1 820 | 803 | (553) | 390 | (163) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 74,23 | 51,35 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 46,09 | 51,26 |
| Autres valeurs mobilières | 0,02 | 0,37 |
| Fonds d'investissement | 1,27 | 6,61 |
| Contrats de mise en pension | 0,13 | 0,23 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,66) | 0,23 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 1,82 | (2,33) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (1,21) | (1,82) |
| Titres vendus à découvert | (12,24) | (10,64) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Australie | 1,88 | 1,91 |
| Belgique | 0,10 | S/O |
| Bésil | S/O | 0,21 |
| Canada | 1,84 | 1,68 |
| Îles Caimans | 2,75 | 2,86 |
| Chine | 3,95 | 2,16 |
| Danemark | 2,21 | 2,57 |
| France | 2,73 | 3,25 |
| Allemagne | 1,84 | 2,47 |
| Hong Kong | S/O | 0,08 |
| Hongrie | 0,27 | 0,03 |
| Irlande | 5,71 | 6,51 |
| Israël | 1,33 | 1,22 |
| Italie | 0,90 | 1,29 |
| Japon | 6,77 | 4,87 |
| Luxembourg | 0,70 | 0,71 |
| Malaisie | 1,37 | 0,92 |
| Mexique | 0,04 | 0,04 |
| Multinationales | 0,09 | 0,11 |
| Pays-Bas | 0,49 | 0,77 |
| Nouvelle-Zélande | 0,08 | 0,09 |
| Norvège | 0,20 | 0,22 |
| Pérou | 0,08 | 1,21 |
| Pologne | 0,30 | 0,03 |
| Portugal | 0,04 | 0,14 |
| Qatar | 0,04 | 0,05 |
| Roumanie | 0,83 | 0,55 |
| Arabie saoudite | 0,57 | S/O |
| Serbie | 0,16 | 0,26 |
| Singapour | 0,24 | S/O |
| Slovénie | 0,22 | 0,22 |
| Corée du Sud | 4,86 | 2,27 |
| Espagne | 1,05 | 1,50 |
| Supranationales | 0,11 | 0,51 |
| Suède | 0,09 | 0,09 |
| Suisse | 1,13 | 0,95 |
| Thaïlande | 0,47 | 0,51 |
| Émirats arabes unis | 0,07 | 0,07 |
| Royaume-Uni | 6,80 | 9,28 |
| États-Unis | 46,45 | 30,13 |
| Instruments à court terme | 21,58 | 21,24 |
| Fonds d'investissement | 1,27 | 6,61 |
| Contrats de mise en pension | 0,13 | 0,23 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,66) | 0,24 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,02) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,14) | (0,13) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,11 | S/O |
| Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base | S/O | 0,01 |
| Swaps de taux d'intérêt | 1,85 | (2,19) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,06 | 0,05 |
| Options sur titres | 0,08 | 0,09 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Options de change | (0,02) | S/O |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,19) | (0,28) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | (0,02) | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps sur devises croisées | 0,01 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | (0,02) |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,20) | 0,07 |
| Contrats de change à terme | (1,05) | (2,07) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,11 | 0,35 |
| Titres vendus à découvert | (12,24) | (10,64) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (9,45) | 4,74 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | ÎLES CAÏMANS | | | | ZF Finance GmbH | | | |
| AUTRICHE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,750 % éch. 21/09/2028 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Diamond Foreign Asset Co. 8,500 % éch. 01/10/2030 | | | | € 4 000 \$ 4 275 0,14 | | | |
| ams-OSRAM AG | | | | Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % éch. 20/09/2025 | | | | Total Allemagne | | | |
| 10,500 % éch. 30/03/2029 | | | | 2 138 2 235 0,07 | | | | | | | |
| 12,250 % éch. 30/03/2029 | | | | UPCB Finance Ltd. 3,625 % éch. 15/06/2029 | | | | 102 641 3,44 | | | |
| Total Autriche | | | | Wynn Macau Ltd. 5,500 % éch. 01/10/2027 | | | | | | | |
| 6 906 0,23 | | | | 11 857 0,40 | | | | | | | |
| BELGIQUE | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | GIBRALTAR | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | American Airlines, Inc. 10,427 % éch. 20/04/2028 | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | |
| Ontex Group NV | | | | Total Îles Caïmans | | | | GVC Holdings (Gibraltar) Ltd. | | | |
| 3,500 % éch. 15/07/2026 | | | | 12 644 0,42 | | | | 8,948 % éch. 31/10/2029 | | | |
| € 7 500 8 014 0,27 | | | | | | | | \$ 591 593 0,02 | | | |
| BERMUDES | | | | RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | | ITALIE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| NCL Corp. Ltd. | | | | EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031 | | | | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | | | |
| 5,875 % éch. 15/02/2027 | | | | € 19 500 16 723 0,56 | | | | 6,750 % éch. 05/09/2027 | | | |
| 8,375 % éch. 01/02/2028 | | | | | | | | € 15 300 17 698 0,59 | | | |
| Seadrill Finance Ltd. | | | | | | | | 7,708 % éch. 18/01/2027 | | | |
| 8,375 % éch. 01/08/2030 | | | | | | | | 2 000 2 215 0,07 | | | |
| Valaris Ltd. | | | | | | | | 8,000 % éch. 22/01/2030 | | | |
| 8,375 % éch. 30/04/2030 | | | | | | | | 10,500 % éch. 23/07/2029 | | | |
| Viking Cruises Ltd. | | | | | | | | 3 000 3 648 0,12 | | | |
| 5,875 % éch. 15/09/2027 | | | | | | | | Cerved Group SpA | | | |
| VOC Escrow Ltd. | | | | | | | | 6,000 % éch. 15/02/2029 | | | |
| 5,000 % éch. 15/02/2028 | | | | | | | | 6 098 6 167 0,21 | | | |
| Total Bermudes | | | | | | | | FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA | | | |
| 25 605 0,86 | | | | | | | | 5,625 % éch. 01/08/2027 | | | |
| CANADA | | | | | | | | 2 000 2 066 0,07 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | IMA Industria Macchine Automatiche SpA | | | |
| Air Canada | | | | | | | | 3,750 % éch. 15/01/2028 | | | |
| 3,875 % éch. 15/08/2026 | | | | | | | | 12 000 12 399 0,42 | | | |
| 4,625 % éch. 15/08/2029 | | | | | | | | Inter Media and Communication SpA | | | |
| CAD 3 000 2 109 0,07 | | | | | | | | 6,750 % éch. 09/02/2027 | | | |
| Air Canada Pass-Through Trust | | | | | | | | Intesa Sanpaolo SpA | | | |
| 3,600 % éch. 15/09/2028 | | | | | | | | 4,198 % éch. 01/06/2032 | | | |
| \$ 374 352 0,01 | | | | | | | | \$ 8 700 7 183 0,24 | | | |
| B.C. Unlimited Liability Co. | | | | | | | | 4,950 % éch. 01/06/2042 | | | |
| 3,500 % éch. 15/02/2029 | | | | | | | | 2 000 1 426 0,05 | | | |
| 11 400 10 523 0,35 | | | | | | | | 5,710 % éch. 15/01/2026 | | | |
| 4,000 % éch. 15/10/2030 | | | | | | | | 3 600 3 585 0,12 | | | |
| 17 600 15 807 0,53 | | | | | | | | 7,700 % éch. 17/09/2025 | | | |
| 4,375 % éch. 15/01/2028 | | | | | | | | (c)(e) | | | |
| 2 500 2 390 0,08 | | | | | | | | 3 500 3 448 0,12 | | | |
| Bausch & Lomb Escrow Corp. | | | | | | | | 7,750 % éch. 11/01/2027 | | | |
| 8,375 % éch. 01/10/2028 | | | | | | | | (c)(e) | | | |
| 9 000 9 506 0,32 | | | | | | | | € 2 000 2 270 0,08 | | | |
| Bombardier, Inc. | | | | | | | | Italmatch Chemicals SpA | | | |
| 7,125 % éch. 15/06/2026 | | | | | | | | 9,393 % éch. 06/02/2028 | | | |
| 4 655 4 637 0,16 | | | | | | | | 4 787 5 282 0,18 | | | |
| 7,500 % éch. 01/02/2029 | | | | | | | | 10,000 % éch. 06/02/2028 | | | |
| 4 000 4 070 0,14 | | | | | | | | 500 572 0,02 | | | |
| 7,875 % éch. 15/04/2027 | | | | | | | | Mundys SpA | | | |
| 2 610 2 613 0,09 | | | | | | | | 1,875 % éch. 12/02/2028 | | | |
| 8,750 % éch. 15/11/2030 | | | | | | | | 12 500 12 719 0,43 | | | |
| 5 300 5 650 0,19 | | | | | | | | Nexi SpA | | | |
| Garda World Security Corp. | | | | | | | | 1,625 % éch. 30/04/2026 | | | |
| 7,750 % éch. 15/02/2028 | | | | | | | | 8 000 8 403 0,28 | | | |
| 1 200 1 243 0,04 | | | | | | | | 2,125 % éch. 30/04/2029 (g) | | | |
| GFL Environmental, Inc. | | | | | | | | 21 200 20 732 0,69 | | | |
| 3,500 % éch. 01/09/2028 | | | | | | | | Shiba BidCo SpA | | | |
| 3 000 2 775 0,09 | | | | | | | | 4,500 % éch. 31/10/2028 | | | |
| 6,750 % éch. 15/01/2031 | | | | | | | | 5 000 5 207 0,17 | | | |
| 1 050 1 083 0,04 | | | | | | | | Telecom Italia SpA | | | |
| goeasy Ltd. | | | | | | | | 1,625 % éch. 18/01/2029 | | | |
| 9,250 % éch. 01/12/2028 | | | | | | | | 5 000 4 789 0,16 | | | |
| 10 300 11 009 0,37 | | | | | | | | 5,303 % éch. 30/05/2024 | | | |
| Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc. | | | | | | | | \$ 2 000 1 992 0,07 | | | |
| 6,000 % éch. 15/09/2028 | | | | | | | | € 25 725 31 648 1,06 | | | |
| 4 800 4 483 0,15 | | | | | | | | UniCredit SpA | | | |
| Strathcona Resources Ltd. | | | | | | | | 5,459 % éch. 30/06/2035 | | | |
| 6,875 % éch. 01/08/2026 | | | | | | | | \$ 24 400 22 977 0,77 | | | |
| 875 836 0,03 | | | | | | | | 7,296 % éch. 02/04/2034 | | | |
| 86 818 2,91 | | | | | | | | 800 823 0,03 | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | | | Total Italie | | | |
| Air Canada | | | | | | | | 182 681 6,13 | | | |
| 9,139 % éch. 11/08/2028 | | | | | | | | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | |
| 1 331 1 337 0,05 | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| B.C. Unlimited Liability Co. | | | | | | | | Adient Global Holdings Ltd. | | | |
| 7,606 % éch. 20/09/2030 | | | | | | | | 3,500 % éch. 15/08/2024 | | | |
| 1 614 1 617 0,05 | | | | | | | | € 747 819 0,03 | | | |
| NorthRiver Midstream Finance LP | | | | | | | | G City Europe Ltd. | | | |
| 8,395 % éch. 16/08/2030 | | | | | | | | 4,250 % éch. 11/09/2025 | | | |
| 499 500 0,02 | | | | | | | | 2 000 2 035 0,07 | | | |
| 3 454 0,12 | | | | | | | | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. | | | |
| Total Canada | | | | | | | | 3,250 % éch. 12/11/2025 (g) | | | |
| 90 272 3,03 | | | | | | | | 7 700 7 731 0,26 | | | |
| LIBÉRIA | | | | | | | | Total Jersey, Îles Anglo-normandes | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | 10 585 0,36 | | | |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. | | | | | | | | LUXEMBOURG | | | |
| 4,250 % éch. 01/07/2026 | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| \$ 5 000 4 833 0,16 | | | | | | | | Albion Financing SARL | | | |
| 5,375 % éch. 15/07/2027 | | | | | | | | 6,125 % éch. 15/10/2026 | | | |
| 5 400 5 349 0,18 | | | | | | | | 6 125 6 074 0,20 | | | |
| 5,500 % éch. 31/08/2026 | | | | | | | | | | | |
| 10 000 9 908 0,33 | | | | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 01/04/2028 | | | | | | | | | | | |
| 7 800 7 705 0,26 | | | | | | | | | | | |
| 7,250 % éch. 15/01/2030 | | | | | | | | | | | |
| 3 000 3 135 0,11 | | | | | | | | | | | |
| Total Libéria | | | | | | | | | | | |
| 30 930 1,04 | | | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Allison Transmission, Inc. 3,750 % éch. 30/01/2031 | \$ 2 000 | \$ 1 769 | 0,06 | 4,250 % éch. 15/01/2034 | \$ 7 000 | \$ 5 698 | 0,19 | Diamond Sports Group LLC 5,375 % éch. 15/08/2026 ^ | \$ 6 000 | \$ 308 | 0,01 |
| 4,750 % éch. 01/10/2027 | 2 000 | 1 934 | 0,07 | 4,500 % éch. 15/08/2030 | 10 000 | 9 028 | 0,30 | Directv Financing LLC 5,875 % éch. 15/08/2027 | 12 500 | 11 755 | 0,39 |
| AMC Networks, Inc. 4,250 % éch. 15/02/2029 | 7 000 | 5 348 | 0,18 | 4,500 % éch. 01/05/2032 | 10 000 | 8 578 | 0,29 | DISH DBS Corp. 5,250 % éch. 01/12/2026 | 6 750 | 5 796 | 0,19 |
| 4,750 % éch. 01/08/2025 | 8 300 | 8 088 | 0,27 | 4,500 % éch. 01/06/2033 | 5 000 | 4 237 | 0,14 | 5,750 % éch. 01/12/2028 | 5 000 | 3 997 | 0,13 |
| American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % éch. 01/11/2028 | 288 | 264 | 0,01 | 4,750 % éch. 01/03/2030 | 7 000 | 6 406 | 0,22 | 5,875 % éch. 15/11/2024 | 2 000 | 1 877 | 0,06 |
| American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 3,875 % éch. 15/11/2029 | 2 000 | 1 785 | 0,06 | 5,125 % éch. 01/05/2027 | 9 000 | 8 701 | 0,29 | 7,750 % éch. 01/07/2026 | 2 000 | 1 395 | 0,05 |
| Amsted Industries, Inc. 4,625 % éch. 15/05/2030 | 5 000 | 4 583 | 0,15 | 5,375 % éch. 01/06/2029 | 3 500 | 3 304 | 0,11 | DISH Network Corp. 11,750 % éch. 15/11/2027 | 5 000 | 5 223 | 0,18 |
| AmWINS Group, Inc. 4,875 % éch. 30/06/2029 | 5 000 | 4 573 | 0,15 | CD&R Smokey Buyer, Inc. 6,750 % éch. 15/07/2025 | 2 275 | 2 253 | 0,08 | DT Midstream, Inc. 4,125 % éch. 15/06/2029 | 5 000 | 4 606 | 0,15 |
| Antero Midstream Partners LP 5,375 % éch. 15/06/2029 | 5 000 | 4 813 | 0,16 | Central Garden & Pet Co. 4,125 % éch. 30/04/2031 | 4 000 | 3 539 | 0,12 | 4,375 % éch. 15/06/2031 | 4 000 | 3 613 | 0,12 |
| 5,750 % éch. 01/03/2027 | 200 | 199 | 0,01 | Central Parent LLC 8,000 % éch. 15/06/2029 | 4 700 | 4 909 | 0,17 | Edgewell Personal Care Co. 4,125 % éch. 01/04/2029 | 1 500 | 1 367 | 0,05 |
| API Group DE, Inc. 4,750 % éch. 15/10/2029 | 3 000 | 2 821 | 0,09 | Charles River Laboratories International, Inc. 3,750 % éch. 15/03/2029 | 2 000 | 1 834 | 0,06 | 5,500 % éch. 01/06/2028 | 2 500 | 2 456 | 0,08 |
| Aramark Services, Inc. 5,000 % éch. 01/02/2028 | 3 000 | 2 912 | 0,10 | 4,000 % éch. 15/03/2031 | 1 000 | 905 | 0,03 | Element Solutions, Inc. 3,875 % éch. 01/09/2028 | 3 200 | 2 949 | 0,10 |
| Ascent Resources Utica Holdings LLC 5,875 % éch. 30/06/2029 | 3 000 | 2 794 | 0,09 | Chesapeake Energy Corp. 5,500 % éch. 01/02/2026 | 2 000 | 1 984 | 0,07 | Embeckta Corp. 5,000 % éch. 15/02/2030 (g) | 6 700 | 5 692 | 0,19 |
| AT&T, Inc. 2,875 % éch. 02/03/2025 (c) | € 7 500 | 7 982 | 0,27 | 5,875 % éch. 01/02/2029 | 1 500 | 1 472 | 0,05 | Emerald Debt Merger Sub LLC 6,625 % éch. 15/12/2030 | 6 425 | 6 570 | 0,22 |
| Avantor Funding, Inc. 3,875 % éch. 15/07/2028 | 4 750 | 5 151 | 0,17 | 6,750 % éch. 15/04/2029 | 12 000 | 12 124 | 0,41 | Endeavor Energy Resources LP 5,750 % éch. 30/01/2028 | 10 000 | 10 016 | 0,34 |
| 4,625 % éch. 15/07/2028 | \$ 2 500 | 2 418 | 0,08 | Churchill Downs, Inc. 5,750 % éch. 01/04/2030 | 3 750 | 3 661 | 0,12 | EnLink Midstream LLC 5,375 % éch. 01/06/2029 | 7 500 | 7 347 | 0,25 |
| B&G Foods, Inc. 8,000 % éch. 15/09/2028 | 4 000 | 4 205 | 0,14 | 6,750 % éch. 01/05/2031 | 5 000 | 5 081 | 0,17 | 5,625 % éch. 15/01/2028 | 1 000 | 990 | 0,03 |
| Ball Corp. 2,875 % éch. 15/08/2030 | 2 500 | 2 148 | 0,07 | Cinemark USA, Inc. 5,250 % éch. 15/07/2028 | 1 800 | 1 653 | 0,06 | 6,500 % éch. 01/09/2030 | 1 750 | 1 789 | 0,06 |
| 3,125 % éch. 15/09/2031 | 1 500 | 1 295 | 0,04 | 5,875 % éch. 15/03/2026 | 775 | 759 | 0,03 | EQM Midstream Partners LP 4,000 % éch. 01/08/2024 | 1 871 | 1 855 | 0,06 |
| Bath & Body Works, Inc. 6,875 % éch. 01/11/2035 | 7 000 | 7 098 | 0,24 | CITGO Petroleum Corp. 8,375 % éch. 15/01/2029 | 4 150 | 4 271 | 0,14 | 4,500 % éch. 15/01/2029 | 11 750 | 11 111 | 0,37 |
| BCPE Empire Holdings, Inc. 7,625 % éch. 01/05/2027 | 12 600 | 12 163 | 0,41 | Clarivate Science Holdings Corp. 3,875 % éch. 01/07/2028 | 3 750 | 3 539 | 0,12 | 4,750 % éch. 15/01/2031 | 5 050 | 4 707 | 0,16 |
| Beacon Roofing Supply, Inc. 6,500 % éch. 01/08/2030 | 1 550 | 1 586 | 0,05 | 4,875 % éch. 01/07/2029 | 4 000 | 3 758 | 0,13 | 6,000 % éch. 01/07/2025 | 735 | 735 | 0,02 |
| Blue Racer Midstream LLC 7,625 % éch. 15/12/2025 | 4 475 | 4 538 | 0,15 | Clearway Energy Operating LLC 3,750 % éch. 15/01/2032 | 2 150 | 1 876 | 0,06 | 6,500 % éch. 01/07/2027 | 5 800 | 5 909 | 0,20 |
| Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % éch. 02/10/2025 | € 3 000 | 3 318 | 0,11 | 4,750 % éch. 15/03/2028 | 2 000 | 1 928 | 0,06 | 6,500 % éch. 15/07/2048 | 4 000 | 4 105 | 0,14 |
| Boyd Gaming Corp. 4,750 % éch. 01/12/2027 | \$ 2 000 | 1 928 | 0,06 | Cloud Software Group, Inc. 6,500 % éch. 31/03/2029 | 8 000 | 7 626 | 0,26 | 7,500 % éch. 01/06/2027 | 1 000 | 1 031 | 0,03 |
| 4,750 % éch. 15/06/2031 | 4 000 | 3 676 | 0,12 | 6,000 % éch. 01/03/2026 | 2 000 | 1 784 | 0,06 | 7,500 % éch. 01/06/2030 | 2 000 | 2 152 | 0,07 |
| Boyne USA, Inc. 4,750 % éch. 15/05/2029 | 5 000 | 4 707 | 0,16 | Community Health Systems, Inc. 4,750 % éch. 15/02/2031 | 5 000 | 3 938 | 0,13 | Fertitta Entertainment LLC 4,625 % éch. 15/01/2029 | 2 000 | 1 817 | 0,06 |
| Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % éch. 15/11/2027 | 100 | 89 | 0,00 | 5,250 % éch. 15/05/2030 | 5 000 | 4 189 | 0,14 | First Student Bidco, Inc. 4,000 % éch. 31/07/2029 | 5 000 | 4 341 | 0,15 |
| 4,550 % éch. 01/10/2029 | 300 | 263 | 0,01 | 5,625 % éch. 15/03/2027 | 8 700 | 8 095 | 0,27 | Ford Motor Co. 6,100 % éch. 19/08/2032 | 4 250 | 4 286 | 0,14 |
| 7,800 % éch. 15/03/2028 | 200 | 202 | 0,01 | 6,000 % éch. 15/01/2029 | 1 625 | 1 465 | 0,05 | Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % éch. 10/08/2026 | 4 000 | 3 707 | 0,12 |
| Buckeye Partners LP 4,125 % éch. 01/03/2025 | 3 000 | 2 912 | 0,10 | 8,000 % éch. 15/03/2026 | 692 | 690 | 0,02 | 3,375 % éch. 13/11/2025 | 2 500 | 2 393 | 0,08 |
| 4,500 % éch. 01/03/2028 | 1 000 | 943 | 0,03 | Comstock Resources, Inc. 5,875 % éch. 15/01/2030 | 2 000 | 1 737 | 0,06 | 4,000 % éch. 13/11/2030 | 12 000 | 10 776 | 0,36 |
| Builders FirstSource, Inc. 4,250 % éch. 01/02/2032 | 3 000 | 2 710 | 0,09 | 6,750 % éch. 01/03/2029 | 4 000 | 3 663 | 0,12 | 4,125 % éch. 17/08/2025 | 2 500 | 2 369 | 0,08 |
| 5,000 % éch. 01/03/2030 | 5 000 | 4 834 | 0,16 | CoreLogic, Inc. 4,500 % éch. 01/05/2028 | 4 197 | 3 681 | 0,12 | 4,134 % éch. 04/08/2025 | 6 000 | 5 835 | 0,20 |
| Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % éch. 01/07/2031 | 7 650 | 8 140 | 0,27 | Coty, Inc. 5,000 % éch. 15/04/2026 | 523 | 515 | 0,02 | Fortrea Holdings, Inc. 7,500 % éch. 01/07/2030 | 2 000 | 2 056 | 0,07 |
| Calpine Corp. 3,750 % éch. 01/03/2031 | 7 000 | 6 148 | 0,21 | 5,750 % éch. 15/09/2028 | € 700 | 816 | 0,03 | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % éch. 01/05/2028 | 2 950 | 2 839 | 0,10 |
| 4,500 % éch. 15/02/2028 | 4 000 | 3 807 | 0,13 | 6,625 % éch. 15/07/2030 | \$ 2 750 | 2 827 | 0,10 | 6,500 % éch. 01/10/2025 | 1 287 | 1 284 | 0,04 |
| 4,625 % éch. 01/02/2029 | 1 500 | 1 395 | 0,05 | Covanta Holding Corp. 4,875 % éch. 01/12/2029 | 3 000 | 2 625 | 0,09 | Freedom Mortgage Corp. 12,000 % éch. 01/10/2028 | 10 900 | 11 913 | 0,40 |
| 5,125 % éch. 15/03/2028 | 4 000 | 3 838 | 0,13 | 5,000 % éch. 01/09/2030 | 3 000 | 2 560 | 0,09 | 12,250 % éch. 01/10/2030 | 7 650 | 8 404 | 0,28 |
| 5,250 % éch. 01/06/2026 | 663 | 655 | 0,02 | Credit Acceptance Corp. 9,250 % éch. 15/12/2028 | 1 700 | 1 814 | 0,06 | Frontier Communications Holdings LLC 5,000 % éch. 01/05/2028 | 2 500 | 2 313 | 0,08 |
| Cantor Fitzgerald LP 7,200 % éch. 12/12/2028 | 1 550 | 1 590 | 0,05 | Credit Suisse AG AT1 Claim | 4 900 | 588 | 0,02 | 5,875 % éch. 15/10/2027 | 3 000 | 2 901 | 0,10 |
| Capstone Borrower, Inc. 8,000 % éch. 15/06/2030 | 3 100 | 3 229 | 0,11 | Crocs, Inc. 4,125 % éch. 15/08/2031 | 4 000 | 3 390 | 0,11 | Gap, Inc. 3,625 % éch. 01/10/2029 | 10 600 | 9 076 | 0,30 |
| Cargo Aircraft Management, Inc. 4,750 % éch. 01/02/2028 | 9 900 | 9 072 | 0,30 | Crown Americas LLC 4,250 % éch. 30/09/2026 | 5 000 | 4 855 | 0,16 | 3,875 % éch. 01/10/2031 | 4 900 | 4 042 | 0,14 |
| Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % éch. 01/03/2028 | € 13 300 | 12 828 | 0,43 | 4,750 % éch. 01/02/2026 | 2 000 | 1 982 | 0,07 | Gartner, Inc. 3,625 % éch. 15/06/2029 | 4 000 | 3 615 | 0,12 |
| CCO Holdings LLC 4,250 % éch. 01/02/2031 | \$ 5 000 | 4 376 | 0,15 | CrownRock LP 5,625 % éch. 15/10/2025 | 2 500 | 2 498 | 0,08 | 3,750 % éch. 01/10/2030 | 2 000 | 1 770 | 0,06 |
| | | | | CSC Holdings LLC 3,375 % éch. 15/02/2031 | 5 000 | 3 653 | 0,12 | 4,500 % éch. 01/07/2028 | 2 000 | 1 898 | 0,06 |
| | | | | 4,125 % éch. 01/12/2030 | 3 500 | 2 667 | 0,09 | Genesis Energy LP 6,250 % éch. 15/05/2026 | 2 000 | 2 000 | 0,07 |
| | | | | 5,500 % éch. 15/04/2027 | 2 000 | 1 850 | 0,06 | 8,250 % éch. 15/01/2029 | 2 875 | 2 961 | 0,10 |
| | | | | Curo Group Holdings Corp. 7,500 % éch. 01/08/2028 | 200 | 68 | 0,00 | 8,875 % éch. 15/04/2030 | 700 | 725 | 0,02 |
| | | | | Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC 8,875 % éch. 01/09/2031 | 1 800 | 1 909 | 0,06 | GN Bondco LLC 9,500 % éch. 15/10/2031 | 7 000 | 6 843 | 0,23 |
| | | | | DaVita, Inc. 4,625 % éch. 01/06/2030 | 12 000 | 10 487 | 0,35 | Go Daddy Operating Co. LLC 3,500 % éch. 01/03/2029 | 5 000 | 4 534 | 0,15 |
| | | | | Diamond Offshore Drilling, Inc. 13,000 % éch. 21/12/2026 | 44 | 43 | 0,00 | GoTo Group, Inc. 5,500 % éch. 01/09/2027 | 2 000 | 969 | 0,03 |

Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------|
| Graphic Packaging International LLC | 2,625 | 1 000 | 0,03 | LFS Topco LLC | 2 500 | 2 303 | 0,08 | OneMain Finance Corp. | 5 000 | 4 631 | 0,16 | |
| 2,625 % éch. 01/02/2029 | € | \$ | | 5,875 % éch. 15/10/2026 | \$ | | | 3,500 % éch. 15/01/2027 | \$ | | | |
| 3,500 % éch. 01/03/2029 | \$ | 2 260 | 0,08 | LifePoint Health, Inc. | 8 200 | 8 646 | 0,29 | 5,375 % éch. 15/11/2029 | 5 000 | 4 689 | 0,16 | |
| Gray Television, Inc. | 500 | 487 | 0,02 | 11,000 % éch. 15/10/2030 | 8 200 | 8 646 | 0,29 | 6,625 % éch. 15/01/2028 | 2 000 | 2 021 | 0,07 | |
| 5,875 % éch. 15/07/2026 | 500 | 487 | 0,02 | Light & Wonder International, Inc. | 2 825 | 2 949 | 0,10 | 6,875 % éch. 15/03/2025 | 5 000 | 5 065 | 0,17 | |
| Greystar Real Estate Partners LLC | 1 225 | 1 285 | 0,04 | 7,500 % éch. 01/09/2031 | 2 825 | 2 949 | 0,10 | 7,125 % éch. 15/03/2026 | 2 000 | 2 039 | 0,07 | |
| 7,750 % éch. 01/09/2030 | 1 225 | 1 285 | 0,04 | Lindblad Expeditions Holdings, Inc. | 5 000 | 5 192 | 0,17 | 9,000 % éch. 15/01/2029 | 3 325 | 3 518 | 0,12 | |
| GTCR W-2 Merger Sub LLC | 5 400 | 5 710 | 0,19 | 9,000 % éch. 15/05/2028 | 5 000 | 5 192 | 0,17 | Organon & Co. | 7 500 | 7 631 | 0,26 | |
| 7,500 % éch. 15/01/2031 | 5 400 | 5 710 | 0,19 | Lindblad Expeditions LLC | 2 800 | 2 788 | 0,09 | 2,875 % éch. 30/04/2028 | € | | | |
| HAT Holdings LLC | 5 400 | 5 079 | 0,17 | 6,750 % éch. 15/02/2027 | 2 800 | 2 788 | 0,09 | 4,125 % éch. 30/04/2028 | \$ | 3 000 | 2 764 | 0,09 |
| 3,375 % éch. 15/06/2026 | 5 400 | 5 079 | 0,17 | Live Nation Entertainment, Inc. | 4 000 | 4 073 | 0,14 | 5,125 % éch. 30/04/2031 | 14 600 | 12 504 | 0,42 | |
| 3,750 % éch. 15/09/2030 | 4 300 | 3 627 | 0,12 | 6,500 % éch. 15/05/2027 | 4 000 | 4 073 | 0,14 | Outfront Media Capital LLC | 2 500 | 2 258 | 0,08 | |
| 8,000 % éch. 15/06/2027 | 14 150 | 14 753 | 0,50 | Madison IAQ LLC | 1 225 | 1 115 | 0,04 | 4,250 % éch. 15/01/2029 | 2 500 | 2 258 | 0,08 | |
| HealthEquity, Inc. | 2 000 | 1 860 | 0,06 | 4,125 % éch. 30/06/2028 | 1 225 | 1 115 | 0,04 | 4,625 % éch. 15/03/2030 | 2 000 | 1 785 | 0,06 | |
| 4,500 % éch. 01/10/2029 | 2 000 | 1 860 | 0,06 | Marriott Ownership Resorts, Inc. | 2 000 | 1 765 | 0,06 | 5,000 % éch. 15/08/2027 | 3 000 | 2 902 | 0,10 | |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. | 2 000 | 1 748 | 0,06 | 4,500 % éch. 15/06/2029 | 2 000 | 1 765 | 0,06 | Owens & Minor, Inc. | 1 950 | 1 864 | 0,06 | |
| 3,625 % éch. 15/02/2032 | 2 000 | 1 748 | 0,06 | Mauser Packaging Solutions Holding Co. | 6 000 | 6 111 | 0,21 | 6,625 % éch. 01/04/2030 (g) | 1 950 | 1 864 | 0,06 | |
| 3,750 % éch. 01/05/2029 | 3 500 | 3 249 | 0,11 | 7,875 % éch. 15/08/2026 | 6 000 | 6 111 | 0,21 | Owens-Brockway Glass Container, Inc. | 2 400 | 2 436 | 0,08 | |
| 4,000 % éch. 01/05/2031 | 3 000 | 2 751 | 0,09 | Medline Borrower LP | 18 250 | 16 523 | 0,55 | 7,250 % éch. 15/05/2031 | 2 400 | 2 436 | 0,08 | |
| Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC | 5 000 | 4 432 | 0,15 | 3,875 % éch. 01/04/2029 | 18 250 | 16 523 | 0,55 | Oxford Finance LLC | 5 300 | 5 015 | 0,17 | |
| 4,875 % éch. 01/07/2031 | 5 000 | 4 432 | 0,15 | 5,250 % éch. 01/10/2029 | 10 000 | 9 439 | 0,32 | 6,375 % éch. 01/02/2027 | 5 300 | 5 015 | 0,17 | |
| 5,000 % éch. 01/06/2029 | 4 000 | 3 695 | 0,12 | MGM Resorts International | 5 000 | 4 883 | 0,16 | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC | 3 000 | 2 808 | 0,09 | |
| Hilton Worldwide Finance LLC | 2 500 | 2 464 | 0,08 | 4,625 % éch. 01/09/2026 | 5 000 | 4 883 | 0,16 | 4,375 % éch. 15/10/2028 | 3 000 | 2 808 | 0,09 | |
| 4,875 % éch. 01/04/2027 | 2 500 | 2 464 | 0,08 | 5,750 % éch. 15/06/2025 | 1 000 | 997 | 0,03 | Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. | 10 000 | 9 356 | 0,31 | |
| Hologic, Inc. | 4 000 | 3 631 | 0,12 | Midcap Financial Issuer Trust | 2 700 | 2 529 | 0,09 | 4,000 % éch. 15/10/2027 | 10 000 | 9 356 | 0,31 | |
| 3,250 % éch. 15/02/2029 | 4 000 | 3 631 | 0,12 | 6,500 % éch. 01/05/2028 | 2 700 | 2 529 | 0,09 | Park Intermediate Holdings LLC | 3 000 | 2 780 | 0,09 | |
| 4,625 % éch. 01/02/2028 | 5 000 | 4 805 | 0,16 | Midwest Gaming Borrower LLC | 6 000 | 5 587 | 0,19 | 4,875 % éch. 15/05/2029 | 3 000 | 2 780 | 0,09 | |
| Howard Hughes Corp. | 4 000 | 3 571 | 0,12 | 4,875 % éch. 01/05/2029 | 6 000 | 5 587 | 0,19 | 7,500 % éch. 01/06/2025 | 1 000 | 1 006 | 0,03 | |
| 4,125 % éch. 01/02/2029 | 4 000 | 3 571 | 0,12 | MPH Acquisition Holdings LLC | 11 045 | 9 902 | 0,33 | PBF Holding Co. LLC | 750 | 765 | 0,03 | |
| 4,375 % éch. 01/02/2031 | 3 000 | 2 607 | 0,09 | 5,500 % éch. 01/09/2028 | 11 045 | 9 902 | 0,33 | 7,875 % éch. 15/09/2030 | 750 | 765 | 0,03 | |
| 5,375 % éch. 01/08/2028 | 1 000 | 963 | 0,03 | Murphy Oil USA, Inc. | 600 | 523 | 0,02 | PDC Energy, Inc. | 2 000 | 1 997 | 0,07 | |
| Howard Midstream Energy Partners LLC | 450 | 445 | 0,02 | 3,750 % éch. 15/02/2031 | 600 | 523 | 0,02 | 5,750 % éch. 15/05/2026 | 2 000 | 1 997 | 0,07 | |
| 6,750 % éch. 15/01/2027 | 450 | 445 | 0,02 | Nabors Industries, Inc. | 2 750 | 2 697 | 0,09 | PennyMac Financial Services, Inc. | 7 500 | 6 760 | 0,23 | |
| 8,875 % éch. 15/07/2028 | 5 775 | 6 068 | 0,20 | 7,375 % éch. 15/05/2027 | 2 750 | 2 697 | 0,09 | 4,250 % éch. 15/02/2029 | 7 500 | 6 760 | 0,23 | |
| Howmet Aerospace, Inc. | 3 000 | 3 135 | 0,11 | Nationstar Mortgage Holdings, Inc. | 5 000 | 4 813 | 0,16 | 5,750 % éch. 15/09/2031 | 2 000 | 1 854 | 0,06 | |
| 5,950 % éch. 01/02/2037 | 3 000 | 3 135 | 0,11 | 5,500 % éch. 15/08/2028 | 5 000 | 4 813 | 0,16 | Performance Food Group, Inc. | 3 000 | 2 755 | 0,09 | |
| Icahn Enterprises LP | 700 | 629 | 0,02 | NCR Atleos Corp. | 12 475 | 13 266 | 0,45 | 4,250 % éch. 01/08/2029 | 3 000 | 2 755 | 0,09 | |
| 5,250 % éch. 15/05/2027 | 700 | 629 | 0,02 | 9,500 % éch. 01/04/2029 | 12 475 | 13 266 | 0,45 | 5,500 % éch. 15/10/2027 | 5 000 | 4 932 | 0,17 | |
| 6,250 % éch. 15/05/2026 | 300 | 286 | 0,01 | NCR Voyix Corp. | 2 500 | 2 299 | 0,08 | Permian Resources Operating LLC | 2 000 | 1 975 | 0,07 | |
| iHeartCommunications, Inc. | 1 500 | 1 155 | 0,04 | 5,250 % éch. 01/10/2030 | 2 500 | 2 299 | 0,08 | 5,375 % éch. 15/01/2026 | 2 000 | 1 975 | 0,07 | |
| 4,750 % éch. 15/01/2028 | 1 500 | 1 155 | 0,04 | Newell Brands, Inc. | 1 250 | 1 245 | 0,04 | 5,875 % éch. 01/07/2029 | 3 000 | 2 929 | 0,10 | |
| 5,250 % éch. 15/08/2027 | 300 | 239 | 0,01 | 6,375 % éch. 15/09/2027 (g) | 1 250 | 1 245 | 0,04 | 6,875 % éch. 01/04/2027 | 4 000 | 4 002 | 0,13 | |
| Imola Merger Corp. | 7 500 | 7 135 | 0,24 | 6,375 % éch. 01/04/2036 | 1 250 | 1 397 | 0,05 | 7,000 % éch. 15/01/2032 | 200 | 206 | 0,01 | |
| 4,750 % éch. 15/05/2029 | 7 500 | 7 135 | 0,24 | Newfold Digital Holdings Group, Inc. | 9 100 | 9 797 | 0,33 | PetSmart, Inc. | 3 775 | 3 562 | 0,12 | |
| IQVIA, Inc. | 5 000 | 5 206 | 0,18 | 11,750 % éch. 15/10/2028 | 9 100 | 9 797 | 0,33 | 4,750 % éch. 15/02/2028 | 3 775 | 3 562 | 0,12 | |
| 2,250 % éch. 15/01/2028 | € | | | Nexstar Media, Inc. | 4 000 | 3 689 | 0,12 | 7,750 % éch. 15/02/2029 | 1 000 | 974 | 0,03 | |
| 2,250 % éch. 15/03/2029 | 3 000 | 3 045 | 0,10 | 4,750 % éch. 01/11/2028 | 4 000 | 3 689 | 0,12 | Post Holdings, Inc. | 1 864 | 1 673 | 0,06 | |
| 2,875 % éch. 15/06/2028 | 3 500 | 3 696 | 0,12 | 5,625 % éch. 15/07/2027 | 4 000 | 3 871 | 0,13 | 4,500 % éch. 15/09/2031 | 5 000 | 4 604 | 0,15 | |
| 5,000 % éch. 15/05/2027 | \$ | 1 000 | 0,03 | NextEra Energy Operating Partners LP | 200 | 191 | 0,01 | 4,625 % éch. 15/04/2030 | 5 000 | 4 604 | 0,15 | |
| Jeld-Wen, Inc. | 500 | 484 | 0,02 | 3,875 % éch. 15/10/2026 | 200 | 191 | 0,01 | 5,500 % éch. 15/12/2029 | 5 000 | 4 823 | 0,16 | |
| 4,625 % éch. 15/12/2025 | 500 | 484 | 0,02 | 4,250 % éch. 15/07/2024 | 2 000 | 1 979 | 0,07 | 5,625 % éch. 15/01/2028 | 5 000 | 4 958 | 0,17 | |
| 4,875 % éch. 15/12/2027 | 2 000 | 1 892 | 0,06 | 4,250 % éch. 15/09/2024 | 262 | 254 | 0,01 | PRA Group, Inc. | 4 400 | 4 378 | 0,15 | |
| Kaiser Aluminum Corp. | 2 000 | 1 727 | 0,06 | 4,500 % éch. 15/09/2027 | 5 975 | 5 756 | 0,19 | 7,375 % éch. 01/09/2025 | 4 400 | 4 378 | 0,15 | |
| 4,500 % éch. 01/06/2031 | 2 000 | 1 727 | 0,06 | 7,250 % éch. 15/01/2029 | 3 000 | 3 143 | 0,11 | Prime Security Services Borrower LLC | 5 000 | 4 639 | 0,16 | |
| 4,625 % éch. 01/03/2028 | 4 000 | 3 704 | 0,12 | NGL Energy Operating LLC | 3 900 | 3 942 | 0,13 | 3,375 % éch. 31/08/2027 | 5 000 | 4 639 | 0,16 | |
| KFC Holding Co. | 3 500 | 3 450 | 0,12 | 7,500 % éch. 01/02/2026 | 3 900 | 3 942 | 0,13 | 5,250 % éch. 15/04/2024 | 267 | 266 | 0,01 | |
| 4,750 % éch. 01/06/2027 | 3 500 | 3 450 | 0,12 | Noble Finance LLC | 8 700 | 9 060 | 0,30 | 5,750 % éch. 15/04/2026 | 4 000 | 4 024 | 0,14 | |
| Kinetik Holdings LP | 3 000 | 2 947 | 0,10 | 8,000 % éch. 15/04/2030 | 8 700 | 9 060 | 0,30 | 6,250 % éch. 15/01/2028 | 5 000 | 4 975 | 0,17 | |
| 5,875 % éch. 15/06/2030 | 3 000 | 2 947 | 0,10 | Novellis Corp. | 3 000 | 2 826 | 0,10 | PTC, Inc. | 1 250 | 1 186 | 0,04 | |
| 6,625 % éch. 15/12/2028 | 1 200 | 1 223 | 0,04 | 3,250 % éch. 15/11/2026 | 3 000 | 2 826 | 0,10 | 4,000 % éch. 15/02/2028 | 1 250 | 1 186 | 0,04 | |
| Kronos International, Inc. | 8 200 | 8 711 | 0,29 | 3,875 % éch. 15/08/2031 | 8 000 | 7 061 | 0,24 | Raising Cane's Restaurants LLC | 900 | 962 | 0,03 | |
| 3,750 % éch. 15/09/2025 | € | | | 4,750 % éch. 30/01/2030 | 7 000 | 6 594 | 0,22 | 9,375 % éch. 01/05/2029 | 900 | 962 | 0,03 | |
| LABL, Inc. | 6 675 | 6 060 | 0,20 | NRG Energy, Inc. | 4 250 | 3 758 | 0,13 | Range Resources Corp. | 2 000 | 1 851 | 0,06 | |
| 5,875 % éch. 01/11/2028 | \$ | | | 3,375 % éch. 15/02/2029 | 4 250 | 3 758 | 0,13 | 4,750 % éch. 15/02/2030 | 2 000 | 1 851 | 0,06 | |
| 6,750 % éch. 15/07/2026 | 5 000 | 4 868 | 0,16 | NSG Holdings LLC | 141 | 140 | 0,00 | Resorts World Las Vegas LLC | 250 | 218 | 0,01 | |
| Lamb Weston Holdings, Inc. | 2 000 | 1 846 | 0,06 | 7,750 % éch. 15/12/2025 | 141 | 140 | 0,00 | 4,625 % éch. 16/04/2029 | 2 000 | 2 065 | 0,07 | |
| 4,125 % éch. 31/01/2030 | 2 000 | 1 846 | 0,06 | NuStar Logistics LP | 2 500 | 2 486 | 0,08 | 8,450 % éch. 27/07/2030 | 2 000 | 2 065 | 0,07 | |
| 4,875 % éch. 15/05/2028 | 2 000 | 1 958 | 0,07 | 5,750 % éch. 01/10/2025 | 2 500 | 2 486 | 0,08 | RHP Hotel Properties LP | 2 500 | 2 327 | 0,08 | |
| Las Vegas Sands Corp. | 20 500 | 18 914 | 0,63 | 6,375 % éch. 01/10/2030 | 2 000 | 2 006 | 0,07 | 4,500 % éch. 15/02/2029 | 1 500 | 1 450 | 0,05 | |
| 3,900 % éch. 08/08/2029 | 20 500 | 18 914 | 0,63 | Olympus Water U.S. Holding Corp. | 10 000 | 10 156 | 0,34 | 4,750 % éch. 15/10/2027 | 1 500 | 1 450 | 0,05 | |
| Legacy LifePoint Health LLC | 4 425 | 4 090 | 0,14 | 3,875 % éch. 01/10/2028 | € | | | Ritchie Bros Holdings, Inc. | 1 400 | 1 443 | 0,05 | |
| 4,375 % éch. 15/02/2027 | 4 425 | 4 090 | 0,14 | 4,250 % éch. 01/10/2028 | \$ | | | 6,750 % éch. 15/03/2028 | 2 500 | 2 668 | 0,09 | |
| Lehman Brothers Holdings, Inc. | 14 200 | 25 | 0,00 | 5,375 % éch. 01/10/2028 | € | | | 7,750 % éch. 15/03/2031 | 2 500 | 2 668 | 0,09 | |
| 0,000 % éch. 25/05/2010 ^ | 14 200 | 25 | 0,00 | 01/10/2029 (g) | € | | | RLJ Lodging Trust LP | 5 000 | 4 498 | 0,15 | |
| Level 3 Financing, Inc. | 2 000 | 1 050 | 0,04 | 7,125 % éch. 01/10/2027 | \$ | | | Rockcliff Energy LLC | 5 000 | 4 732 | 0,16 | |
| 3,625 % éch. 15/01/2029 | 2 000 | 1 050 | 0,04 | ON Semiconductor Corp. | 3 500 | 3 249 | 0,11 | 5,500 % éch. 15/10/2029 | 5 000 | 4 732 | 0,16 | |
| 3,7 | | | | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Rocket Mortgage LLC | | | | 3,500 % éch. 01/03/2029 | 5 000 | 4 479 | 0,15 | AppLovin Corp. | | | |
| 3,625 % éch. 01/03/2029 | \$ 1 750 | \$ 1 586 | 0,05 | Triumph Group, Inc. | | | | 8,456 % éch. 16/08/2030 | 1 015 | 1 017 | 0,03 |
| 3,875 % éch. 01/03/2031 | 3 000 | 2 642 | 0,09 | 9,000 % éch. 15/03/2028 | 5 125 | 5 456 | 0,18 | Avis Budget Car Rental LLC | | | |
| 4,000 % éch. 15/10/2033 | 2 000 | 1 701 | 0,06 | Twilio, Inc. | | | | 8,456 % éch. 16/03/2029 | 268 | 269 | 0,01 |
| Rockies Express Pipeline LLC | | | | 3,625 % éch. 15/03/2029 | 4 000 | 3 654 | 0,12 | Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc. | | | |
| 3,600 % éch. 15/05/2025 | 1 500 | 1 453 | 0,05 | 3,875 % éch. 15/03/2031 | 3 000 | 2 678 | 0,09 | 7,848 % éch. 20/12/2029 | 678 | 681 | 0,02 |
| 4,800 % éch. 15/05/2030 | 2 000 | 1 833 | 0,06 | U.S. Foods, Inc. | | | | B&G Foods, Inc. | | | |
| 4,950 % éch. 15/07/2029 | 4 000 | 3 829 | 0,13 | 4,625 % éch. 01/06/2030 | 1 650 | 1 539 | 0,05 | 7,856 % éch. 10/10/2026 | 201 | 200 | 0,01 |
| Sabre GLBL, Inc. | | | | 4,750 % éch. 15/02/2029 | 6 400 | 6 083 | 0,20 | Barnes Group, Inc. | | | |
| 8,625 % éch. 01/06/2027 | 2 000 | 1 822 | 0,06 | 6,875 % éch. 15/09/2028 | 1 250 | 1 288 | 0,04 | 8,456 % éch. 03/09/2030 | 324 | 326 | 0,01 |
| 11,250 % éch. 15/12/2027 | 2 280 | 2 242 | 0,08 | 7,250 % éch. 15/01/2032 | 1 800 | 1 879 | 0,06 | Brookfield Property REIT, Inc. | | | |
| SBA Communications Corp. | | | | Uber Technologies, Inc. | | | | 7,856 % éch. 27/08/2025 | 739 | 738 | 0,03 |
| 3,125 % éch. 01/02/2029 | 7 000 | 6 297 | 0,21 | 4,500 % éch. 15/08/2029 | 7 000 | 6 691 | 0,22 | Calpine Construction Finance Co. LP | | | |
| 3,875 % éch. 15/02/2027 | 7 000 | 6 727 | 0,23 | UGI International LLC | | | | 7,606 % éch. 31/07/2030 | 499 | 499 | 0,02 |
| SCIL LLC | | | | 2,500 % éch. 01/12/2029 | € 11 430 | 10 783 | 0,36 | Calpine Corp. | | | |
| 9,500 % éch. 15/07/2028 | € 2 475 | 2 922 | 0,10 | United Airlines, Inc. | | | | 7,970 % éch. 16/12/2027 | 350 | 351 | 0,01 |
| Scotts Miracle-Gro Co. | | | | 4,375 % éch. 15/04/2026 | \$ 5 400 | 5 266 | 0,18 | Carnival Corp. | | | |
| 4,375 % éch. 01/02/2032 | \$ 1 150 | 973 | 0,03 | 4,625 % éch. 15/04/2029 | 11 900 | 11 142 | 0,37 | 8,357 % éch. 08/08/2027 | 2 427 | 2 436 | 0,08 |
| Sensata Technologies, Inc. | | | | Univision Communications, Inc. | | | | Central Parent, Inc. | | | |
| 3,750 % éch. 15/02/2031 | 6 000 | 5 297 | 0,18 | 4,500 % éch. 01/05/2029 | 8 000 | 7 147 | 0,24 | 9,348 % - 9,360 % éch. 06/07/2029 | 246 | 248 | 0,01 |
| Silgan Holdings, Inc. | | | | 5,125 % éch. 15/02/2025 | 922 | 919 | 0,03 | Ciena Corp. | | | |
| 2,250 % éch. 01/06/2028 | € 5 750 | 5 864 | 0,20 | 6,625 % éch. 01/06/2027 | 5 000 | 4 990 | 0,17 | 7,358 % éch. 24/10/2030 | 300 | 301 | 0,01 |
| Sirius XM Radio, Inc. | | | | 8,000 % éch. 15/08/2028 | 1 760 | 1 817 | 0,06 | CQP Holdco LP | | | |
| 3,875 % éch. 01/09/2031 | \$ 1 775 | 1 521 | 0,05 | USI, Inc. | | | | 8,360 % éch. 31/12/2030 | 1 293 | 1 297 | 0,04 |
| 4,000 % éch. 15/07/2028 | 7 000 | 6 478 | 0,22 | 7,500 % éch. 15/01/2032 | 500 | 513 | 0,02 | Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC | | | |
| 5,000 % éch. 01/08/2027 | 4 400 | 4 253 | 0,14 | Venture Global Calcasieu Pass LLC | | | | 8,706 % éch. 31/01/2030 | 770 | 766 | 0,03 |
| SM Energy Co. | | | | 3,875 % éch. 15/08/2029 | 4 500 | 4 088 | 0,14 | DirecTV Financing LLC | | | |
| 6,500 % éch. 15/07/2028 | 2 000 | 2 003 | 0,07 | 3,875 % éch. 01/11/2033 | 2 500 | 2 122 | 0,07 | 10,650 % éch. 02/08/2027 | 1 321 | 1 324 | 0,05 |
| 6,625 % éch. 15/01/2027 | 2 000 | 1 991 | 0,07 | 4,125 % éch. 15/08/2031 | 3 775 | 3 331 | 0,11 | E.W. Scripps Co. | | | |
| Southwestern Energy Co. | | | | 6,250 % éch. 15/01/2030 | 10 000 | 9 959 | 0,33 | 8,033 % éch. 01/05/2026 | 734 | 733 | 0,03 |
| 5,375 % éch. 01/02/2029 | 2 500 | 2 442 | 0,08 | Venture Global LNG, Inc. | | | | Elanco Animal Health, Inc. | | | |
| 5,375 % éch. 15/03/2030 | 5 000 | 4 888 | 0,16 | 8,125 % éch. 01/06/2028 | 5 300 | 5 357 | 0,18 | 7,193 % éch. 01/08/2027 | 474 | 472 | 0,02 |
| Spectrum Brands, Inc. | | | | 8,375 % éch. 01/06/2031 | 10 100 | 10 110 | 0,34 | Emrld Borrower LP | | | |
| 3,875 % éch. 15/03/2031 | 3 000 | 2 733 | 0,09 | 9,500 % éch. 01/02/2029 | 2 200 | 2 329 | 0,08 | 8,356 % - 8,380 % éch. 31/05/2030 | 599 | 601 | 0,02 |
| 5,000 % éch. 01/10/2029 | 2 000 | 1 910 | 0,06 | 9,875 % éch. 01/02/2032 | 2 200 | 2 293 | 0,08 | FinCo LLC | | | |
| Spirit AeroSystems, Inc. | | | | Vertiv Group Corp. | | | | 8,383 % éch. 27/06/2029 | 624 | 627 | 0,02 |
| 9,375 % éch. 30/11/2029 | 3 000 | 3 287 | 0,11 | 4,125 % éch. 15/11/2028 | 3 000 | 2 817 | 0,09 | Foundation Building Materials Holding Co. LLC | | | |
| 9,750 % éch. 15/11/2030 | 6 880 | 7 404 | 0,25 | Viavi Solutions, Inc. | | | | 8,895 % éch. 31/01/2028 | 788 | 787 | 0,03 |
| SRS Distribution, Inc. | | | | 3,750 % éch. 01/10/2029 | 2 375 | 2 082 | 0,07 | Go Daddy Operating Co. LLC | | | |
| 4,625 % éch. 01/07/2028 | 7 000 | 6 649 | 0,22 | Victoria's Secret & Co. | | | | 7,856 % éch. 09/11/2029 | 807 | 811 | 0,03 |
| Standard Industries, Inc. | | | | 4,625 % éch. 15/07/2029 | 4 000 | 3 346 | 0,11 | Great Outdoors Group LLC | | | |
| 2,250 % éch. 21/11/2026 | € 19 700 | 20 645 | 0,69 | Vistra Operations Co. LLC | | | | 9,220 % éch. 06/03/2028 | 1 183 | 1 185 | 0,04 |
| 3,375 % éch. 15/01/2031 | \$ 2 000 | 1 724 | 0,06 | 7,750 % éch. 15/10/2031 | 6 000 | 6 236 | 0,21 | Grifols Worldwide Operations USA, Inc. | | | |
| 4,375 % éch. 15/07/2030 | 2 000 | 1 839 | 0,06 | White Cap Buyer LLC | | | | 7,538 % éch. 15/11/2027 | 399 | 399 | 0,01 |
| 4,750 % éch. 15/01/2028 | 2 000 | 1 927 | 0,06 | 6,875 % éch. 15/10/2028 | 7 375 | 7 148 | 0,24 | Hilton Domestic Operating Co., Inc. | | | |
| Star Parent, Inc. | | | | White Cap Parent LLC (8,250 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) | | | | 7,455 % éch. 08/11/2030 | 375 | 377 | 0,01 |
| 9,000 % éch. 01/10/2030 | 500 | 528 | 0,02 | 8,250 % éch. 15/03/2026 (b) | 3 000 | 2 990 | 0,10 | Hilton Grand Vacations Borrower LLC | | | |
| Station Casinos LLC | | | | Williams Scotsman, Inc. | | | | 8,220 % éch. 02/08/2028 | 199 | 200 | 0,01 |
| 4,500 % éch. 15/02/2028 | 3 000 | 2 831 | 0,10 | 7,375 % éch. 01/10/2031 | 6 600 | 6 926 | 0,23 | Hudson River Trading LLC | | | |
| Suburban Propane Partners LP | | | | WMG Acquisition Corp. | | | | 8,470 % éch. 20/03/2028 | 326 | 326 | 0,01 |
| 5,000 % éch. 01/06/2031 | 5 000 | 4 540 | 0,15 | 2,250 % éch. 15/08/2031 | € 3 500 | 3 403 | 0,11 | II-VI, Inc. | | | |
| Summer BC Bidco LLC | | | | 3,875 % éch. 15/07/2030 | \$ 5 000 | 4 529 | 0,15 | 8,220 % éch. 02/07/2029 | 1 305 | 1 312 | 0,04 |
| 5,500 % éch. 31/10/2026 | 1 300 | 1 219 | 0,04 | Wyndham Hotels & Resorts, Inc. | | | | Informatica LLC | | | |
| Tallgrass Energy Partners LP | | | | 4,375 % éch. 15/08/2028 | 5 000 | 4 679 | 0,16 | 8,220 % éch. 27/10/2028 | 347 | 348 | 0,01 |
| 5,500 % éch. 15/01/2028 | 5 000 | 4 730 | 0,16 | Wynn Las Vegas LLC | | | | Ingram Micro Inc. | | | |
| 6,000 % éch. 31/12/2030 | 1 000 | 931 | 0,03 | 5,250 % éch. 15/05/2027 | 5 000 | 4 870 | 0,16 | 8,610 % éch. 30/06/2028 | 600 | 603 | 0,02 |
| 7,500 % éch. 01/10/2025 | 2 000 | 2 012 | 0,07 | 5,500 % éch. 01/03/2025 | 830 | 826 | 0,03 | Iridium Satellite LLC | | | |
| Tapestry, Inc. | | | | Wynn Resorts Finance LLC | | | | 7,856 % éch. 20/09/2030 | 313 | 315 | 0,01 |
| 7,700 % éch. 27/11/2030 | 4 375 | 4 609 | 0,16 | 7,125 % éch. 15/02/2031 | 2 500 | 2 606 | 0,09 | Jane Street Group LLC | | | |
| TEGNA, Inc. | | | | XPO, Inc. | | | | 8,220 % éch. 26/01/2028 | 657 | 660 | 0,02 |
| 4,625 % éch. 15/03/2028 | 3 000 | 2 806 | 0,09 | 7,125 % éch. 01/06/2031 | 100 | 104 | 0,00 | LifePoint Health, Inc. | | | |
| 4,750 % éch. 15/03/2026 | 2 000 | 1 947 | 0,07 | Yum! Brands, Inc. | | | | 11,168 % éch. 16/11/2028 | 1 200 | 1 199 | 0,04 |
| 5,000 % éch. 15/09/2029 | 5 000 | 4 588 | 0,15 | 3,625 % éch. 15/03/2031 | 5 000 | 4 515 | 0,15 | MH Sub LLC | | | |
| Tenet Healthcare Corp. | | | | 4,625 % éch. 31/01/2032 | 1 000 | 936 | 0,03 | 9,606 % éch. 03/05/2028 | 1 486 | 1 463 | 0,05 |
| 4,375 % éch. 15/01/2030 | 6 750 | 6 263 | 0,21 | 6,875 % éch. 15/11/2037 | 2 000 | 2 198 | 0,07 | MKS Instruments, Inc. | | | |
| 4,625 % éch. 15/06/2028 | 5 000 | 4 775 | 0,16 | Zayo Group Holdings, Inc. | | | | 7,841 % éch. 17/08/2029 | 1 077 | 1 082 | 0,04 |
| 4,875 % éch. 01/01/2026 | 2 000 | 1 979 | 0,07 | 4,000 % éch. 01/03/2027 | 1 000 | 803 | 0,03 | Option Care Health, Inc. | | | |
| 5,125 % éch. 01/11/2027 | 5 000 | 4 891 | 0,16 | ZF North America Capital, Inc. | | | | 8,220 % éch. 27/10/2028 | 520 | 522 | 0,02 |
| 6,125 % éch. 15/06/2030 | 5 000 | 5 062 | 0,17 | 6,875 % éch. 14/04/2028 | 1 000 | 1 037 | 0,04 | Organon & Co. | | | |
| TerraForm Power Operating LLC | | | | 7,125 % éch. 14/04/2030 | 1 000 | 1 067 | 0,04 | 8,472 % éch. 02/06/2028 | 700 | 703 | 0,02 |
| 4,750 % éch. 15/01/2030 | 1 500 | 1 397 | 0,05 | ZoomInfo Technologies LLC | | | | | | | |
| 5,000 % éch. 31/01/2028 | 6 500 | 6 319 | 0,21 | 3,875 % éch. 01/02/2029 | 5 000 | 4 538 | 0,15 | | | | |
| TransDigm, Inc. | | | | | | 1 555 221 | 52,18 | | | | |
| 4,625 % éch. 15/01/2029 | 18 600 | 17 475 | 0,59 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 15/11/2027 | 8 000 | 7 845 | 0,26 | American Builders & Contractors Supply Co., Inc. | | | | | | | |
| 6,250 % éch. 15/03/2026 | 6 000 | 5 996 | 0,20 | 7,356 % - 7,456 % éch. 15/01/2027 | \$ 170 | \$ 171 | 0,01 | | | | |
| 6,750 % éch. 15/08/2028 | 2 000 | 2 049 | 0,07 | API Group, Inc. | | | | | | | |
| 6,875 % éch. 15/12/2030 | 10 200 | 10 513 | 0,35 | 7,970 % éch. 03/01/2029 | 753 | 754 | 0,03 | | | | |
| 7,125 % éch. 01/12/2031 | 2 200 | 2 308 | 0,08 | | | | | | | | |
| Travel + Leisure Co. | | | | | | | | | | | |
| 4,625 % éch. 01/03/2030 | \$ 5 000 | \$ 4 478 | 0,15 | | | | | | | | |
| 6,625 % éch. 31/07/2026 | 4 000 | 4 039 | 0,14 | | | | | | | | |
| TriNet Group, Inc. | | | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Oryx Midstream Services Permian Basin LLC 8,710 % éch. 05/10/2028 | \$ 314 | \$ 315 | 0,01 | Station Casinos LLC 7,706 % éch. 08/02/2027 | \$ 1 174 | \$ 1 177 | 0,04 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| Pacific Gas & Electric Co. 7,856 % éch. 23/06/2025 | 550 | 552 | 0,02 | Tempo Acquisition LLC 8,106 % éch. 31/08/2028 | 932 | 937 | 0,03 | Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025 | | | |
| PetSmart, Inc. 9,206 % éch. 11/02/2028 | 1 470 | 1 456 | 0,05 | TransDigm, Inc. 8,598 % éch. 22/02/2027 | 384 | 386 | 0,01 | 4,250 % éch. 15/10/2025 (g) | | | |
| Polaris Newco LLC 9,470 % éch. 02/06/2028 | 432 | 427 | 0,01 | Trident TPI Holdings, Inc. 9,610 % éch. 15/09/2028 | 685 | 684 | 0,02 | 5,000 % éch. 31/10/2025 | | | |
| Prime Security Services Borrower LLC 7,841 % éch. 14/10/2030 | 550 | 552 | 0,02 | U.S. Foods, Inc. 7,970 % éch. 22/11/2028 | 811 | 816 | 0,03 | 147 243 4,94 | | | |
| Rand Parent LLC 9,598 % éch. 17/03/2030 | 299 | 299 | 0,01 | U.S. Renal Care, Inc. 10,470 % éch. 20/06/2028 | 0 | 0 | 0,00 | Total États-Unis | | | |
| Red Ventures LLC 8,356 % éch. 03/03/2030 | 349 | 349 | 0,01 | United Airlines, Inc. 9,220 % éch. 21/04/2028 | 2 140 | 2 151 | 0,07 | 1 745 681 58,57 | | | |
| Reynolds Consumer Products LLC 7,206 % éch. 04/02/2027 | 350 | 351 | 0,01 | USI, Inc. 8,348 % éch. 22/11/2029 | 355 | 356 | 0,01 | Total des Valeurs mobilières | | | |
| Scientific Games Holdings LP 8,598 % - 8,914 % éch. 04/04/2029 | 249 | 250 | 0,01 | Vertiv Group Corp. 7,974 % éch. 02/03/2027 | 933 | 937 | 0,03 | \$ 2 863 479 96,08 | | | |
| Scientific Games International, Inc. 8,465 % éch. 14/04/2029 | 399 | 401 | 0,01 | WMG Acquisition Corp. 7,481 % éch. 20/01/2028 | 1 000 | 1 002 | 0,03 | ACTIONS | | | |
| Sotera Health Holdings LLC 8,395 % éch. 11/12/2026 | 650 | 650 | 0,02 | Worldpay LLC TBD % éch. 31/01/2031 | 1 500 | 1 508 | 0,05 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| Spirit Aerosystems, Inc. 9,633 % éch. 15/01/2027 | 590 | 592 | 0,02 | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| SS&C Technologies, Inc. 7,706 % éch. 22/03/2029 | 959 | 962 | 0,03 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,852 % éch. 25/05/2047 | 28 | 4 | 0,00 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (d) | | | |
| | | | | | | 43 213 | 1,45 | PIMCO Funds: Global Investors Seri es plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (d) | | | |
| | | | | | | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d) | | | |
| | | | | | | | | 891 085 8 880 0,30 | | | |
| | | | | | | | | 76 320 2,56 | | | |
| | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement \$ 76 320 2,56 | | | |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|----------------------|---------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 1 146 | \$ (2 496) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 146 | (669) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 131 | 307 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 129 | (735) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 12 | 107 | 0,00 |
| | | | | \$ (3 486) | (0,12) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (3 486) | (0,12) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Cellnex Telecom S.A. | 5,000 % | 20/12/2030 | € 17 900 | \$ 684 | 0,02 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20/06/2028 | 15 700 | 530 | 0,02 |
| Newell Brands, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | \$ 2 400 | 60 | 0,00 |
| | | | | \$ 1 274 | 0,04 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/12/2028 | \$ 21 087 | \$ 586 | 0,02 |
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | € 23 400 | 952 | 0,03 |
| | | | | \$ 1 538 | 0,05 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 % | 20/03/2029 | € 69 600 | \$ 2 290 | 0,08 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 5 102 | 0,17 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽³⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| JLN | Cellnex Telecom S.A. | 5,000 % | 20/06/2028 | € 200 | \$ 30 | \$ 7 | \$ 37 | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 5 485 | \$ 6 951 | \$ 0 | \$ (41) | \$ (41) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 715 978 | 788 034 | 3 | (3 056) | (3 053) | (0,10) |
| | 01/2024 | £ 7 727 | 9 801 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 418 | € 3 129 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € 496 | \$ 543 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | CAD 2 138 | 1 580 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 1 344 | 1 465 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 758 | € 5 338 | 140 | 0 | 140 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | € 1 744 | \$ 1 934 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 427 | 546 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD 160 | 121 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 777 | £ 2 958 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 41 900 | \$ 53 026 | 0 | (390) | (390) | (0,01) |
| | | | | \$ 192 | \$ (3 610) | \$ (3 418) | (0,11) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et Institutions en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ 1 467 | CHF 1 280 | \$ 55 | \$ 0 | \$ 55 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | CHF 10 | \$ 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 258 | CHF 8 066 | 330 | 0 | 330 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | 10 228 | 8 963 | 427 | 0 | 427 | 0,02 |
| MYI | 01/2024 | 10 277 | 8 971 | 387 | 0 | 387 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 199 | \$ 0 | \$ 1 199 | 0,04 |

Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 998 | \$ 2 158 | \$ 0 | \$ (50) | \$ (50) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 455 726 | € 414 549 | 2 315 | (3) | 2 312 | 0,08 |
| BRC | 01/2024 | 385 584 | 350 601 | 1 796 | 0 | 1 796 | 0,06 |
| CBK | 01/2024 | € 18 029 | \$ 19 715 | 0 | (207) | (207) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 385 | € 356 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 258 | \$ 283 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 343 336 | € 314 000 | 3 605 | 0 | 3 605 | 0,12 |
| | | | | \$ 7 724 | \$ (262) | \$ 7 462 | 0,25 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et E en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 809 | \$ 1 023 | \$ 0 | \$ (8) | \$ (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 19 141 | £ 15 106 | 117 | 0 | 117 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 19 713 | 15 539 | 98 | (1) | 97 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 327 | 258 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 2 008 | \$ 2 542 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 203 | 258 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 3 395 | 4 319 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 89 | £ 71 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 648 | \$ 815 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 214 | £ 168 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 111 228 | 87 936 | 876 | 0 | 876 | 0,03 |
| SSB | 01/2024 | £ 202 | \$ 254 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 70 735 | £ 56 056 | 728 | 0 | 728 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | £ 314 | \$ 393 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 111 207 | £ 87 871 | 814 | 0 | 814 | 0,03 |
| | | | | \$ 2 637 | \$ (58) | \$ 2 579 | 0,09 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| DUB | 01/2024 | \$ 1 848 | SGD 2 456 | \$ 15 | \$ 0 | \$ 15 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SGD 20 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 288 | SGD 385 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 148 | 198 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | 224 | 295 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 1 723 | 2 299 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 38 | \$ 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | \$ 1 786 | SGD 2 383 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 12 | \$ 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 7 | SGD 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 62 | \$ 0 | \$ 62 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 7 921 0,27

Total des Investissements

\$ 2 949 336 98,96

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 30 914 1,04

Actifs nets

\$ 2 980 250 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,00 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Altice France S.A. | 11,500 % | 01/02/2027 | 20/12/2023 | \$ 2 906 | \$ 3 038 | 0,10 |

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 21 426 \$ (31 décembre 2022 : 10 952 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 566 \$ (31 décembre 2022 : 205 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 31 571 \$ (31 décembre 2022 : 20 021 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 2 520 \$ (31 décembre 2022 : 8 590 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 2 863 432 | \$ 47 | \$ 2 863 479 |
| Fonds d'investissement | 76 320 | 0 | 0 | 76 320 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (3 058) | 12 595 | 0 | 9 537 |
| Totaux | \$ 73 262 | \$ 2 876 027 | \$ 47 | \$ 2 949 336 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 2 850 743 | \$ 43 | \$ 2 850 786 |
| Fonds d'investissement | 201 583 | 0 | 0 | 201 583 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 11 412 | 0 | 11 412 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 933 | 15 128 | 0 | 16 061 |
| Totaux | \$ 202 516 | \$ 2 877 283 | \$ 43 | \$ 3 079 842 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 0,000 % | 13/10/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (1 688) | \$ (1 871) | (0,06) |
| | 4,500 | 22/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | \$ (1 400) | (1 407) | (0,05) |
| | 5,000 | 22/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (409) | (412) | (0,01) |
| BRC | 2,900 | 20/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (1 784) | (1 985) | (0,07) |
| BSN | 5,510 | 14/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (6 092) | (6 109) | (0,21) |
| JML | 2,250 | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (268) | (297) | (0,01) |
| | 3,000 | 08/06/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (2 124) | (2 380) | (0,08) |
| | 3,000 | 12/06/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (1 273) | (1 426) | (0,05) |
| MYI | 3,000 | 19/10/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (2 528) | (2 809) | (0,09) |
| | 2,500 | 17/05/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (1 266) | (1 421) | (0,05) |
| TDM | 2,000 | 27/10/2023 | TBD ⁽¹⁾ | \$ (434) | (436) | (0,01) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (20 553) | (0,69) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ 68 | \$ 0 | \$ 68 | \$ 1 580 | \$ (1 340) | \$ 240 |
| BPS | (704) | 2 520 | 1 816 | 33 | 0 | 33 |
| BRC | 1 854 | (3 880) | (2 026) | 9 | 0 | 9 |

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| CBK | \$ 108 | \$ 0 | \$ 108 | \$ 11 688 | \$ (11 530) | \$ 158 |
| DUB | 15 | 0 | 15 | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 431 | (420) | 11 | 3 | (10) | (7) |
| JLN | 37 | 0 | 37 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | 0 | (40) | (40) | (416) | 50 | (366) |
| MBC | 3 675 | (5 510) | (1 835) | 8 000 | (7 460) | 540 |
| MYI | 398 | (400) | (2) | (51) | 0 | (51) |
| SCX | 876 | (1 240) | (364) | (9 114) | 8 540 | (574) |
| SSB | 725 | (630) | 95 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 21 | 0 | 21 | 100 | (180) | (80) |
| UAG | 417 | (370) | 47 | 5 | 0 | 5 |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 47,81 | 49,58 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 47,88 | 42,29 |
| Autres valeurs mobilières | 0,39 | 0,01 |
| Fonds d'investissement | 2,56 | 6,50 |
| Contrats de mise en pension | S/O | 0,37 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,12) | 0,03 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,17 | 0,10 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,27 | 0,38 |
| Contrats de prise en pension | (0,69) | (0,34) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Autriche | 0,23 | S/O |
| Belgique | 0,27 | 0,22 |
| Bermudes | 0,86 | 0,40 |
| Canada | 3,03 | 1,55 |
| Îles Caïmans | 0,42 | 0,78 |
| Danemark | S/O | 0,09 |
| République tchèque | 0,56 | S/O |
| France | 3,40 | 1,95 |
| Allemagne | 3,44 | 2,67 |
| Gibraltar | 0,02 | S/O |
| Irlande | S/O | 0,22 |
| Italie | 6,13 | 3,75 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,36 | 0,20 |
| Libéria | 1,04 | 0,67 |
| Luxembourg | 3,42 | 2,47 |
| Multinationales | 1,43 | 1,67 |
| Pays-Bas | 4,61 | 5,00 |
| Norvège | 0,08 | 0,34 |
| Panama | 0,81 | 0,53 |
| Espagne | 1,54 | 1,70 |
| Suède | 1,12 | 0,91 |
| Suisse | 0,01 | 0,11 |
| Royaume-Uni | 4,73 | 3,84 |
| États-Unis | 58,57 | 59,77 |
| Instruments à court terme | S/O | 3,04 |
| Fonds d'investissement | 2,56 | 6,50 |
| Contrats de mise en pension | S/O | 0,37 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,12) | 0,03 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,04 | S/O |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,05 | 0,10 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,08 | S/O |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | S/O |
| Contrats de change à terme | (0,11) | (0,64) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,38 | 1,02 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 1,04 | 0,74 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | |
| AUSTRALIE | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | | | | |
| Aurizon Network Pty. Ltd. 3,125 % éch. 01/06/2026 | € 5 700 | \$ 6 242 | 0,06 | Bacardi Ltd. 2,750 % éch. 15/07/2026 | \$ 1 543 | \$ 1 455 | 0,01 | Betony CLO Ltd. 6,732 % éch. 30/04/2031 | \$ 3 753 | \$ 3 755 | 0,03 |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,437 % éch. 04/04/2025 | 800 | 885 | 0,01 | 4,450 % éch. 15/05/2025 | 10 410 | 10 273 | 0,10 | Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd. 4,213 % éch. 16/12/2041 | 4 155 | 3 920 | 0,04 |
| Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % éch. 01/05/2028 | \$ 415 | 383 | 0,00 | 4,700 % éch. 15/05/2028 | 26 330 | 25 822 | 0,24 | Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,691 % éch. 15/05/2031 | 7 614 | 7 607 | 0,07 |
| CIMIC Finance Ltd. 1,500 % éch. 28/05/2029 | € 4 300 | 4 137 | 0,04 | Searhill Finance Ltd. 8,375 % éch. 01/08/2030 | 300 | 313 | 0,00 | 6,795 % éch. 15/07/2031 | 5 390 | 5 384 | 0,05 |
| GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 1,900 % éch. 14/12/2028 | AUD 23 500 | 13 681 | 0,13 | VOC Escrow Ltd. 5,000 % éch. 15/02/2028 | 1 200 | 1 150 | 0,01 | CIFC Funding Ltd. 6,640 % éch. 24/04/2031 | 3 953 | 3 954 | 0,04 |
| GTA Finance Co. Pty. Ltd. 2,200 % éch. 26/08/2027 | 7 200 | 4 399 | 0,04 | Total Bermudes | | 49 699 | 0,46 | 6,864 % éch. 17/10/2031 | 4 800 | 4 803 | 0,04 |
| Lendlease Finance Ltd. 3,400 % éch. 27/10/2027 | 9 900 | 6 148 | 0,06 | | | 55 895 | 0,52 | Elevation CLO Ltd. 6,775 % éch. 15/07/2031 | 995 | 995 | 0,01 |
| Macquarie University 3,500 % éch. 07/09/2028 | 250 | 160 | 0,00 | BRESIL | | | | KDAC Aviation Finance Ltd. 4,212 % éch. 15/12/2042 | 3 494 | 2 944 | 0,03 |
| Network Finance Co. Pty. Ltd. 6,061 % éch. 19/06/2030 | 700 | 495 | 0,00 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Madison Park Funding Ltd. 6,405 % éch. 15/04/2029 | 2 840 | 2 829 | 0,03 |
| Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % éch. 20/06/2029 | € 6 700 | 6 497 | 0,06 | Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % éch. 10/01/2025 | 14 000 | 13 765 | 0,13 | Northwoods Capital Ltd. 6,758 % éch. 19/04/2031 | 9 717 | 9 728 | 0,09 |
| Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % éch. 22/03/2028 | \$ 15 700 | 14 723 | 0,14 | CSN Resources S.A. 5,875 % éch. 08/04/2032 | 8 100 | 7 052 | 0,06 | 7,246 % éch. 15/06/2031 | 976 | 978 | 0,01 |
| Qantas Airways Ltd. 3,150 % éch. 27/09/2028 | AUD 500 | 309 | 0,00 | Total Brésil | | 20 817 | 0,19 | Palmer Square CLO Ltd. 6,687 % éch. 18/04/2031 | 1 970 | 1 969 | 0,02 |
| Santos Finance Ltd. 4,125 % éch. 14/09/2027 | \$ 7 800 | 7 428 | 0,07 | CANADA | | | | Romark WM-R Ltd. 6,707 % éch. 20/04/2031 | 2 813 | 2 813 | 0,02 |
| 5,250 % éch. 13/03/2029 | 21 303 | 20 867 | 0,20 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Sapphire Aviation Finance Ltd. 4,250 % éch. 15/03/2040 | 4 395 | 3 919 | 0,04 |
| 6,875 % éch. 19/09/2033 | 4 800 | 5 095 | 0,05 | Air Canada Pass-Through Trust 3,300 % éch. 15/07/2031 | 2 332 | 2 098 | 0,02 | Sound Point CLO Ltd. 6,655 % éch. 15/04/2031 | 5 123 | 5 114 | 0,05 |
| Woodside Finance Ltd. 3,700 % éch. 15/03/2028 | 600 | 564 | 0,01 | 3,600 % éch. 15/09/2028 | 5 245 | 4 939 | 0,05 | 6,797 % éch. 21/01/2031 | 3 780 | 3 776 | 0,03 |
| 4,500 % éch. 04/03/2029 | 26 115 | 25 115 | 0,23 | 3,750 % éch. 15/06/2029 | 2 553 | 2 352 | 0,02 | 6,821 % éch. 26/10/2031 | 6 500 | 6 504 | 0,06 |
| | | 117 128 | 1,10 | 4,125 % éch. 15/11/2026 | 3 134 | 3 018 | 0,03 | Steele Creek CLO Ltd. 6,744 % éch. 21/04/2031 | 971 | 972 | 0,01 |
| | | | | 5,250 % éch. 01/10/2030 | 3 114 | 3 057 | 0,03 | Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. 4,212 % éch. 17/05/2032 | 2 049 | 1 900 | 0,02 |
| | | | | Bank of Montreal 4,689 % éch. 28/07/2029 | 5 000 | 5 035 | 0,05 | Trinitas CLO Ltd. 6,777 % éch. 20/07/2031 | 5 868 | 5 871 | 0,05 |
| | | | | Bank of Nova Scotia 4,900 % éch. 04/06/2025 (g)(i) | 17 869 | 17 112 | 0,16 | Wind River CLO Ltd. 6,707 % éch. 18/07/2031 | 905 | 905 | 0,01 |
| | | | | Brookfield Finance, Inc. 3,500 % éch. 30/03/2051 | 19 100 | 13 992 | 0,13 | | 98 138 | 0,91 | |
| | | | | 3,900 % éch. 25/01/2028 | 3 000 | 2 892 | 0,03 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | 4,700 % éch. 20/09/2047 | 1 801 | 1 570 | 0,01 | Alibaba Group Holding Ltd. 2,125 % éch. 09/02/2031 | 2 000 | 1 659 | 0,02 |
| | | | | 4,850 % éch. 29/03/2029 | 8 834 | 8 789 | 0,08 | 4,400 % éch. 06/12/2057 | 8 000 | 6 524 | 0,06 |
| | | | | Canadian Pacific Railway Co. 3,100 % éch. 02/12/2051 | 8 000 | 5 787 | 0,05 | Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027 | 14 256 | 12 643 | 0,12 |
| | | | | CI Financial Corp. 4,100 % éch. 15/06/2051 | 11 237 | 6 608 | 0,06 | 2,875 % éch. 15/02/2025 | 8 300 | 8 012 | 0,08 |
| | | | | Enbridge, Inc. 4,250 % éch. 01/12/2026 | 10 504 | 10 368 | 0,10 | 4,250 % éch. 15/04/2026 | 3 013 | 2 912 | 0,03 |
| | | | | 5,700 % éch. 08/03/2033 | 2 068 | 2 150 | 0,02 | 4,375 % éch. 01/05/2026 | 2 310 | 2 237 | 0,02 |
| | | | | 6,000 % éch. 15/11/2028 | 11 800 | 12 398 | 0,12 | 5,500 % éch. 15/01/2026 | 18 600 | 18 492 | 0,17 |
| | | | | Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % éch. 29/03/2028 | € 29 201 | 30 837 | 0,29 | China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % éch. 14/07/2026 | 9 200 | 8 171 | 0,08 |
| | | | | 4,850 % éch. 17/04/2028 | \$ 100 | 99 | 0,00 | Gaci First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030 | 2 600 | 2 603 | 0,02 |
| | | | | Honda Canada Finance, Inc. 1,646 % éch. 25/02/2028 | CAD 7 082 | 4 828 | 0,05 | 4,875 % éch. 14/02/2035 | 1 700 | 1 664 | 0,02 |
| | | | | Royal Bank of Canada 3,500 % éch. 25/07/2028 | € 1 000 | 1 134 | 0,01 | 5,125 % éch. 14/02/2053 | 13 000 | 11 805 | 0,11 |
| | | | | 4,851 % éch. 14/12/2026 | \$ 8 900 | 8 971 | 0,08 | GGAM Finance Ltd. 8,000 % éch. 15/02/2027 | 2 700 | 2 771 | 0,03 |
| | | | | Toronto-Dominion Bank 4,680 % éch. 08/01/2029 | CAD 14 396 | 11 045 | 0,10 | Goodman HK Finance 4,375 % éch. 19/06/2024 | 3 500 | 3 474 | 0,03 |
| | | | | | | 159 079 | 1,49 | Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % éch. 06/06/2025 | 16 760 | 16 271 | 0,15 |
| | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,250 % éch. 26/04/2026 | 3 650 | 3 522 | 0,03 |
| | | | | Obligation internationale du gouvernement australien 2,750 % éch. 01/12/2048 | 500 | 360 | 0,00 | 5,375 % éch. 04/12/2029 | 3 027 | 2 678 | 0,03 |
| | | | | Province de l'Ontario 2,050 % éch. 02/06/2030 | 9 927 | 6 878 | 0,06 | 5,625 % éch. 17/07/2027 | 8 241 | 7 731 | 0,07 |
| | | | | 2,600 % éch. 02/06/2025 | 151 500 | 112 285 | 1,05 | 5,750 % éch. 21/07/2028 | 2 100 | 1 947 | 0,02 |
| | | | | Province du Québec 1,900 % éch. 01/09/2030 | 4 500 | 3 079 | 0,03 | MGM China Holdings Ltd. 4,750 % éch. 01/02/2027 | 9 900 | 9 426 | 0,09 |
| | | | | | | 122 602 | 1,14 | 5,250 % éch. 18/06/2025 | 8 100 | 7 961 | 0,07 |
| | | | | Total Canada | | 281 681 | 2,63 | 5,375 % éch. 15/05/2024 | 1 255 | 1 250 | 0,01 |
| | | | | ÎLES CAÏMANS | | | | 5,875 % éch. 15/05/2026 | 6 746 | 6 609 | 0,06 |
| | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | Sands China Ltd. 2,550 % éch. 08/03/2027 (k) | 1 000 | 910 | 0,01 |
| | | | | Ares CLO Ltd. 6,825 % éch. 15/10/2030 | \$ 8 970 | 8 979 | 0,08 | 3,100 % éch. 08/03/2029 | 1 500 | 1 309 | 0,01 |
| | | | | Atlas Senior Loan Fund Ltd. 6,745 % éch. 15/01/2031 | 7 574 | 7 585 | 0,07 | 4,300 % éch. 08/01/2026 | 10 000 | 9 609 | 0,09 |
| | | | | 6,805 % éch. 16/01/2030 | 935 | 934 | 0,01 | 5,650 % éch. 08/08/2028 | 24 248 | 24 061 | 0,22 |
| | | | | | | | | Suci Second Investment Co. 6,000 % éch. 25/10/2028 | 800 | 847 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % éch. 17/07/2026 | \$ 10 500 | \$ 10 605 | 0,10 | OP Mortgage Bank 3,375 % éch. 15/02/2027 | € 6 000 | \$ 6 744 | 0,06 | ALLEMAGNE | | | |
| Tencent Holdings Ltd. 2,390 % éch. 03/06/2030 | 8 266 | 7 048 | 0,07 | SATO Oyj 1,375 % éch. 24/02/2028 | 6 571 | 6 061 | 0,06 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 3,240 % éch. 03/06/2050 | 5 200 | 3 472 | 0,03 | Teollisuuden Voima Oyj 4,750 % éch. 01/06/2030 | 1 200 | 1 391 | 0,01 | Bayer AG 0,625 % éch. 12/07/2031 | € 1 000 | \$ 876 | 0,01 |
| 3,290 % éch. 03/06/2060 | 700 | 444 | 0,00 | Total Finlande | | 28 647 | 0,27 | Commerzbank AG 3,375 % éch. 12/12/2025 | 900 | 1 004 | 0,01 |
| Tencent Music Entertainment Group 2,000 % éch. 03/09/2030 | 2 800 | 2 275 | 0,02 | FRANCE | | | | Deutsche Bank AG 1,750 % éch. 19/11/2030 | 40 300 | 38 758 | 0,36 |
| Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1,625 % éch. 24/09/2025 | 11 300 | 10 655 | 0,10 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,625 % éch. 16/12/2024 | £ 15 000 | 18 541 | 0,17 |
| Wynn Macau Ltd. 4,875 % éch. 01/10/2024 | 2 135 | 2 110 | 0,02 | Altarea S.C.A. 1,750 % éch. 16/01/2030 | 11 200 | 9 578 | 0,09 | Deutsche Boerse AG 3,875 % éch. 28/09/2033 | € 8 800 | 10 361 | 0,10 |
| 5,500 % éch. 15/01/2026 | 8 554 | 8 356 | 0,08 | 1,875 % éch. 17/01/2028 | 5 700 | 5 305 | 0,05 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % éch. 09/07/2024 | 9 200 | 10 032 | 0,09 |
| 5,500 % éch. 01/10/2027 | 2 000 | 1 891 | 0,02 | Altice France S.A. 5,125 % éch. 15/07/2029 | \$ 1 200 | 935 | 0,01 | 1,875 % éch. 31/03/2028 | 8 353 | 8 738 | 0,08 |
| Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % éch. 14/07/2031 | 1 900 | 1 582 | 0,01 | BNP Paribas S.A. 2,219 % éch. 09/06/2026 | 21 000 | 20 058 | 0,19 | 2,125 % éch. 09/07/2027 | 14 700 | 15 812 | 0,15 |
| Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % éch. 13/01/2026 | 7 100 | 6 622 | 0,06 | 2,871 % éch. 19/04/2032 | 3 700 | 3 132 | 0,03 | Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % éch. 22/09/2026 | 100 | 102 | 0,00 |
| | | 232 158 | 2,17 | 3,500 % éch. 16/11/2027 | 20 000 | 18 886 | 0,18 | IHO Verwaltungen GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature) 3,750 % éch. 15/09/2026 (b) | 19 590 | 21 397 | 0,20 |
| Total Îles Caïmans | | 330 296 | 3,08 | 5,198 % éch. 10/01/2030 | 15 000 | 15 030 | 0,14 | Robert Bosch GmbH 3,625 % éch. 02/06/2030 | 2 000 | 2 272 | 0,02 |
| CHILI | | | | 8,500 % éch. 14/08/2028 (g)(i) | 6 000 | 6 298 | 0,06 | 4,000 % éch. 02/06/2035 | 2 200 | 2 581 | 0,02 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | BPCE S.A. 6,612 % éch. 19/10/2027 | 4 500 | 4 635 | 0,04 | 4,375 % éch. 02/06/2043 | 300 | 356 | 0,00 |
| Celeo Redes Operacion Chile S.A. 5,200 % éch. 22/06/2047 | 1 505 | 1 344 | 0,01 | 6,714 % éch. 19/10/2029 | 30 000 | 31 621 | 0,29 | Sixt SE 1,750 % éch. 09/12/2024 | 10 958 | 11 894 | 0,11 |
| Empresa Electrica Cochran SpA 5,500 % éch. 14/05/2027 | 839 | 796 | 0,01 | Bureau Veritas S.A. 1,875 % éch. 06/01/2025 | € 15 200 | 16 435 | 0,15 | Volkswagen Bank GmbH 4,375 % éch. 03/05/2028 | 400 | 456 | 0,01 |
| Total Chili | | 2 140 | 0,02 | Crédit Agricole S.A. 6,316 % éch. 03/10/2029 | \$ 6 100 | 6 395 | 0,06 | 4,625 % éch. 03/05/2031 | 5 300 | 6 152 | 0,06 |
| CHINE | | | | Électricité de France S.A. 4,625 % éch. 25/01/2043 | € 1 700 | 1 981 | 0,02 | Volkswagen Leasing GmbH 1,500 % éch. 19/06/2026 | 7 500 | 7 936 | 0,08 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,875 % éch. 21/09/2038 | € 12 600 | 11 673 | 0,11 | Vonovia SE 0,250 % éch. 01/09/2028 | 8 900 | 8 371 | 0,08 |
| State Grid Overseas Investment BVI Ltd. 0,797 % éch. 05/08/2026 | € 12 223 | 12 609 | 0,12 | 5,500 % éch. 25/01/2035 | £ 5 000 | 6 450 | 0,06 | Total Allemagne | | 165 639 | 1,55 |
| 2,125 % éch. 02/05/2030 | 5 217 | 5 140 | 0,05 | 5,625 % éch. 25/01/2053 | 5 300 | 6 638 | 0,06 | GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | |
| Total Chine | | 17 749 | 0,17 | 6,900 % éch. 23/05/2053 | \$ 4 100 | 4 645 | 0,04 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| COLOMBIE | | | | 9,125 % éch. 15/03/2033 (g) | 3 400 | 3 804 | 0,04 | Amdocs Ltd. 2,538 % éch. 15/06/2030 | \$ 5 875 | 5 071 | 0,05 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,475 % éch. 18/01/2031 | € 9 200 | 8 735 | 0,08 | Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % éch. 29/07/2026 | € 16 713 | 15 237 | 0,14 |
| Ecopetrol S.A. 8,875 % éch. 13/01/2033 | \$ 7 900 | 8 593 | 0,08 | 1,625 % éch. 18/09/2029 | 3 600 | 3 583 | 0,03 | 3,000 % éch. 29/03/2025 | 421 | 426 | 0,00 |
| RÉPUBLIQUE TCHÈQUE | | | | Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement 0,625 % éch. 16/09/2028 | 3 200 | 3 081 | 0,03 | Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % éch. 22/06/2026 | 8 300 | 8 292 | 0,08 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Indigo Group S.A.S. 1,625 % éch. 19/04/2028 | 9 700 | 9 980 | 0,09 | 1,750 % éch. 24/11/2028 | 10 100 | 9 292 | 0,09 |
| EP Infrastructure A/S 1,659 % éch. 26/04/2024 | € 5 400 | 5 888 | 0,06 | Kering S.A. 5,125 % éch. 23/11/2026 | £ 2 000 | 2 602 | 0,02 | Total Guernesey, Îles Anglo-normandes | | 38 318 | 0,36 |
| 1,816 % éch. 02/03/2031 | 8 000 | 6 861 | 0,06 | New Immo Holding S.A. 2,750 % éch. 26/11/2026 | € 2 800 | 2 845 | 0,03 | HONG KONG | | | |
| 2,045 % éch. 09/10/2028 | 3 300 | 3 055 | 0,03 | Peugeot Invest 1,875 % éch. 30/10/2026 | 18 300 | 19 332 | 0,18 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Total République tchèque | | 15 804 | 0,15 | SEB S.A. 1,375 % éch. 16/06/2025 | 6 800 | 7 233 | 0,07 | AIA Group Ltd. 4,950 % éch. 04/04/2033 | \$ 300 | 302 | 0,00 |
| DANEMARK | | | | Société Générale S.A. 2,889 % éch. 09/06/2032 | \$ 24 213 | 20 000 | 0,19 | Lenovo Group Ltd. 3,421 % éch. 02/11/2030 (k) | 6 400 | 5 656 | 0,05 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,691 % éch. 10/01/2034 | 26 900 | 28 436 | 0,27 | | | 5 958 | 0,05 |
| GN Store Nord A/S 0,875 % éch. 25/11/2024 | 13 661 | 14 465 | 0,14 | Société Générale SFH S.A. 3,625 % éch. 31/07/2026 | € 9 000 | 10 148 | 0,09 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Jyske Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053 | DKK 8 634 | 1 042 | 0,01 | TDF Infrastructure SASU 1,750 % éch. 01/12/2029 | 9 100 | 8 795 | 0,08 | Airport Authority Hong Kong 2,400 % éch. 08/03/2028 (g) | 2 350 | 2 083 | 0,02 |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 | 4 010 | 469 | 0,00 | 2,500 % éch. 07/04/2026 | 7 100 | 7 656 | 0,07 | 3,450 % éch. 21/02/2029 | 5 500 | 5 234 | 0,05 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | 94 058 | 10 912 | 0,10 | Teleperformance SE 5,250 % éch. 22/11/2028 | 1 400 | 1 619 | 0,02 | | | 7 317 | 0,07 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 9 219 | 1 044 | 0,01 | Thales S.A. 4,000 % éch. 18/10/2025 | 2 600 | 2 912 | 0,03 | Total Hong Kong | | 13 275 | 0,12 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 6 805 | 820 | 0,01 | Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % éch. 24/11/2027 | 18 400 | 17 349 | 0,16 | INDE | | | |
| 4,625 % éch. 19/01/2029 | € 6 600 | 7 543 | 0,07 | Worldline S.A. 4,125 % éch. 12/09/2028 | 8 000 | 8 774 | 0,08 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 29 867 | 3 465 | 0,03 | | | 336 579 | 3,14 | Adani Transmission Step-One Ltd. 4,250 % éch. 21/05/2036 | 16 249 | 13 115 | 0,12 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 3 664 | 395 | 0,00 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | Bharti Airtel Ltd. 4,375 % éch. 10/06/2025 | 5 000 | 4 932 | 0,05 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 6 816 | 822 | 0,01 | Altice France S.A. 9,465 % éch. 15/08/2028 | 4 195 | 4 175 | 0,04 | ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027 | 4 778 | 4 574 | 0,04 |
| Total Danemark | | 40 977 | 0,38 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Total Inde | | 22 621 | 0,21 |
| FINLANDE | | | | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3,000 % éch. 25/11/2031 | 4 300 | 4 878 | 0,05 | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Total France | | 345 632 | 3,23 | | | | |
| Balder Finland Oyj 1,000 % éch. 20/01/2029 | € 13 904 | 11 738 | 0,11 | | | | | | | | |
| Nokia Oyj 4,375 % éch. 12/06/2027 | \$ 2 800 | 2 713 | 0,03 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| INDONÉSIE | | | | JAPON | | | | ÎLE MAURICE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia | | | | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | | | CPI Property Group S.A. | | | |
| 2,800 % éch. 23/06/2030 | \$ 6 600 | \$ 5 965 | 0,05 | 0,953 % éch. 19/07/2025 | \$ 14 400 | \$ 14 033 | 0,13 | 1,500 % éch. 27/01/2031 | € 10 269 | \$ 6 001 | 0,06 |
| 4,450 % éch. 20/02/2029 | 600 | 599 | 0,01 | 1,538 % éch. 20/07/2027 | 9 500 | 8 685 | 0,08 | 1,750 % éch. 14/01/2030 | 10 150 | 6 408 | 0,06 |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara | | | | 2,048 % éch. 17/07/2030 | | | | Cromwell Ereit Lux Finco SARL | | | |
| 4,000 % éch. 30/06/2050 | 7 800 | 6 050 | 0,06 | 3,195 % éch. 18/07/2029 | 5 600 | 5 150 | 0,05 | 2,125 % éch. 19/11/2025 | 19 376 | 20 208 | 0,19 |
| 4,125 % éch. 15/05/2027 | 1 400 | 1 363 | 0,01 | 3,273 % éch. 19/09/2025 | € 3 100 | 3 404 | 0,03 | Helvetia Europe S.A. | | | |
| 4,875 % éch. 17/07/2049 | 700 | 621 | 0,01 | 5,422 % éch. 22/02/2029 | \$ 2 700 | 2 751 | 0,03 | 2,750 % éch. 30/09/2041 | 4 600 | 4 415 | 0,04 |
| 6,150 % éch. 21/05/2048 | 2 300 | 2 362 | 0,02 | 5,475 % éch. 22/02/2031 | 3 837 | 3 935 | 0,04 | Logicor Financing SARL | | | |
| Total Indonésie | | 16 960 | 0,16 | Mizuho Financial Group, Inc. | | | | 1,625 % éch. 15/07/2027 | | | |
| | | | | 1,979 % éch. 08/09/2031 | 7 100 | 5 794 | 0,05 | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | |
| | | | | 2,201 % éch. 10/07/2031 | 9 100 | 7 581 | 0,07 | 5,125 % éch. 29/10/2022 ^ | \$ 61 150 | 3 669 | 0,03 |
| | | | | 4,416 % éch. 20/05/2033 | € 5 000 | 5 826 | 0,05 | 5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (i) | 12 200 | 732 | 0,01 |
| | | | | 5,739 % éch. 27/05/2031 | \$ 568 | 585 | 0,01 | TMS Issuer SARL | | | |
| | | | | Nippon Life Insurance Co. | | | | 5,780 % éch. 23/08/2032 | | | |
| | | | | 6,250 % éch. 13/09/2053 | 4 300 | 4 516 | 0,04 | Total Luxembourg | | | |
| | | | | Nissan Motor Co. Ltd. | | | | 96 879 | | | |
| | | | | 4,345 % éch. 17/09/2027 | 13 557 | 12 980 | 0,12 | 0,90 | | | |
| | | | | 4,810 % éch. 17/09/2030 | 3 100 | 2 900 | 0,03 | ÎLE MAURICE | | | |
| | | | | Nomura Holdings, Inc. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | 1,851 % éch. 16/07/2025 | 15 950 | 15 110 | 0,14 | India Green Energy Holdings | | | |
| | | | | 2,172 % éch. 14/07/2028 | 5 000 | 4 396 | 0,04 | 5,375 % éch. 29/04/2024 | | | |
| | | | | 2,679 % éch. 16/07/2030 | 1 800 | 1 535 | 0,01 | 9 900 | | | |
| | | | | 2,710 % éch. 22/01/2029 | 9 800 | 8 686 | 0,08 | 9 802 | | | |
| | | | | 3,103 % éch. 16/01/2030 | 3 873 | 3 425 | 0,03 | 0,09 | | | |
| | | | | 5,842 % éch. 18/01/2028 | 9 500 | 9 709 | 0,09 | ACTIONS | | | |
| | | | | 6,181 % éch. 18/01/2033 | 8 000 | 8 578 | 0,08 | ACTIONS ORDINAIRES | | | |
| | | | | (k) | | | | Desarrolladora Homex | | | |
| | | | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | | S.A.B. de C.V. (c) | | | |
| | | | | 2,440 % éch. 18/06/2024 | 11 500 | 11 333 | 0,11 | 427 064 | | | |
| | | | | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | | 0 | | | |
| | | | | 2,130 % éch. 08/07/2030 | 3 500 | 2 950 | 0,03 | 0,00 | | | |
| | | | | 2,696 % éch. 16/07/2024 | 4 700 | 4 632 | 0,04 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | 2,750 % éch. 15/01/2030 | 2 018 | 1 786 | 0,02 | Banco Mercantil del Norte S.A. | | | |
| | | | | 5,464 % éch. 13/01/2026 | 6 000 | 6 060 | 0,06 | 6,625 % éch. | | | |
| | | | | 5,520 % éch. 13/01/2028 | 5 000 | 5 121 | 0,05 | 24/01/2032 (g)(i) | | | |
| | | | | 5,710 % éch. 13/01/2030 | 10 000 | 10 392 | 0,10 | \$ 9 400 | | | |
| | | | | 5,716 % éch. 14/09/2028 | 5 400 | 5 595 | 0,05 | 8 009 | | | |
| | | | | 5,766 % éch. 13/01/2033 | 4 500 | 4 758 | 0,04 | 0,08 | | | |
| | | | | 6,796 % éch. 13/01/2026 | 1 400 | 1 411 | 0,01 | 2,750 % éch. 21/04/2027 | | | |
| | | | | Suntory Holdings Ltd. | | | | € 200 | | | |
| | | | | 2,250 % éch. 16/10/2024 | 900 | 876 | 0,01 | 3,750 % éch. 21/02/2024 | | | |
| | | | | Total Japon | | | | 4,875 % éch. 21/02/2028 | | | |
| | | | | | | | | 10,000 % éch. 07/02/2033 | | | |
| | | | | | | | | \$ 8 000 | | | |
| | | | | | | | | 8 042 | | | |
| | | | | | | | | 0,08 | | | |
| | | | | | | | | Trust Fibra Uno | | | |
| | | | | | | | | 4,869 % éch. 15/01/2030 | | | |
| | | | | | | | | 1 900 | | | |
| | | | | | | | | 1 722 | | | |
| | | | | | | | | 18 552 | | | |
| | | | | | | | | 0,02 | | | |
| | | | | | | | | 0,18 | | | |
| | | | | | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| | | | | | | | | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | |
| | | | | | | | | 2,750 % éch. | | | |
| | | | | | | | | 27/11/2031 (f) MXN 414 165 | | | |
| | | | | | | | | 21 596 | | | |
| | | | | | | | | 0,20 | | | |
| | | | | | | | | 3,000 % éch. 03/12/2026 (f) 161 468 | | | |
| | | | | | | | | 8 858 | | | |
| | | | | | | | | 0,08 | | | |
| | | | | | | | | 4,000 % éch. 30/11/2028 (f) 273 729 | | | |
| | | | | | | | | 15 807 | | | |
| | | | | | | | | 0,15 | | | |
| | | | | | | | | 46 261 | | | |
| | | | | | | | | 0,43 | | | |
| | | | | | | | | Total Mexique | | | |
| | | | | | | | | 64 813 | | | |
| | | | | | | | | 0,61 | | | |
| | | | | | | | | MULTINATIONALES | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Delta Air Lines, Inc. | | | |
| | | | | | | | | 4,750 % éch. 20/10/2028 | | | |
| | | | | | | | | \$ 3 125 | | | |
| | | | | | | | | 3 076 | | | |
| | | | | | | | | 0,03 | | | |
| | | | | | | | | PAYS-BAS | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | ABN AMRO Bank NV | | | |
| | | | | | | | | 6,575 % éch. 13/10/2026 | | | |
| | | | | | | | | 10 000 | | | |
| | | | | | | | | 10 170 | | | |
| | | | | | | | | 0,10 | | | |
| | | | | | | | | Achmea Bank NV | | | |
| | | | | | | | | 3,750 % éch. 19/10/2026 | | | |
| | | | | | | | | € 5 500 | | | |
| | | | | | | | | 6 219 | | | |
| | | | | | | | | 0,06 | | | |
| | | | | | | | | Arcadis NV | | | |
| | | | | | | | | 4,875 % éch. 28/02/2028 | | | |
| | | | | | | | | 6 900 | | | |
| | | | | | | | | 7 905 | | | |
| | | | | | | | | 0,07 | | | |
| | | | | | | | | ASR Nederland NV | | | |
| | | | | | | | | 3,375 % éch. 02/05/2049 | | | |
| | | | | | | | | 4 300 | | | |
| | | | | | | | | 4 423 | | | |
| | | | | | | | | 0,04 | | | |
| | | | | | | | | 7,000 % éch. 07/12/2043 | | | |
| | | | | | | | | 2 600 | | | |
| | | | | | | | | 3 249 | | | |
| | | | | | | | | 0,03 | | | |
| | | | | | | | | BMW Finance NV | | | |
| | | | | | | | | 4,125 % éch. 04/10/2033 | | | |
| | | | | | | | | 3 900 | | | |
| | | | | | | | | 4 650 | | | |
| | | | | | | | | 0,04 | | | |
| | | | | | | | | BP Capital Markets BV | | | |
| | | | | | | | | 4,323 % éch. 12/05/2035 | | | |
| | | | | | | | | 2 500 | | | |
| | | | | | | | | 2 935 | | | |
| | | | | | | | | 0,03 | | | |
| | | | | | | | | Cooperative Rabobank UA | | | |
| | | | | | | | | 4,375 % éch. 29/06/2027 (g)(i) | | | |
| | | | | | | | | 19 000 | | | |
| | | | | | | | | 19 705 | | | |
| | | | | | | | | 0,18 | | | |
| | | | | | | | | CTP NV | | | |
| | | | | | | | | 0,500 % éch. 21/06/2025 | | | |
| | | | | | | | | 9 199 | | | |
| | | | | | | | | 9 583 | | | |
| | | | | | | | | 0,09 | | | |
| | | | | | | | | 1,250 % éch. 21/06/2029 | | | |
| | | | | | | | | 12 800 | | | |
| | | | | | | | | 11 739 | | | |
| | | | | | | | | 0,11 | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Danfoss Finance BV 0,125 % éch. 28/04/2026 | € 2 000 | \$ 2 054 | 0,02 | ÉMISSIONS SOUVERAINES BNG Bank NV 2,375 % éch. 16/03/2026 | \$ 9 200 | \$ 8 815 | 0,08 | SLOVAQUIE ÉMISSIONS SOUVERAINES Obligation internationale du gouvernement slovaque 1,875 % éch. 09/03/2037 | € 500 | \$ 458 | 0,00 |
| Digital Dutch Finco BV 1,000 % éch. 15/01/2032 | 2 600 | 2 294 | 0,02 | Total Pays-Bas | | 315 431 | 2,94 | SLOVÉNIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % éch. 27/01/2025 | 10 600 | 11 657 | 0,11 |
| 1,250 % éch. 01/02/2031 | 12 188 | 11 291 | 0,11 | NORVÈGE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS Sparebanken Vest Boligkreditt A/S 3,375 % éch. 15/11/2028 | € 2 000 | 2 270 | 0,02 | AFRIQUE DU SUD OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS AngloGold Ashanti Holdings PLC 3,375 % éch. 01/11/2028 | \$ 5 300 | 4 775 | 0,05 |
| EnBW International Finance BV 3,500 % éch. 24/07/2028 | 5 000 | 5 618 | 0,05 | Var Energi ASA 8,000 % éch. 15/11/2032 | \$ 9 800 | 11 018 | 0,10 | 3,750 % éch. 01/10/2030 | 7 800 | 6 787 | 0,06 |
| 4,000 % éch. 24/01/2035 | 7 175 | 8 201 | 0,08 | Yara International ASA 4,750 % éch. 01/06/2028 | 15 147 | 14 795 | 0,14 | Total Afrique du Sud | | 82 043 | 0,77 |
| Enel Finance International NV 1,875 % éch. 12/07/2028 | \$ 600 | 524 | 0,01 | Total Norvège | | 28 083 | 0,26 | ÉMISSIONS SOUVERAINES Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | 1 231 20 | | |
| 5,500 % éch. 15/06/2052 | 5 000 | 4 732 | 0,04 | PÉROU OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % éch. 17/09/2024 | PEN 9 800 | 2 571 | 0,02 | ZAR 0 | 70 481 | 0,66 | |
| IMCD NV 4,875 % éch. 18/09/2028 | € 4 600 | 5 330 | 0,05 | POLOGNE ÉMISSIONS SOUVERAINES Obligation internationale du gouvernement polonais 3,875 % éch. 14/02/2033 | € 7 300 | 8 409 | 0,08 | Total Corée du Sud | | 20 989 | 0,20 |
| Imperial Brands Finance Netherlands BV 5,250 % éch. 15/02/2031 | 7 000 | 8 015 | 0,07 | 4,250 % éch. 14/02/2043 | 2 300 | 2 680 | 0,02 | ESPAGNE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS Kookmin Bank 4,000 % éch. 13/04/2027 | € 3 600 | 4 089 | 0,04 |
| ING Groep NV 6,250 % éch. 20/05/2033 | £ 4 900 | 6 298 | 0,06 | Total Pologne | | 11 089 | 0,10 | Shinhan Bank Co. Ltd. 1,183 % éch. 29/09/2025 | AUD 7 200 | 4 614 | 0,04 |
| JAB Holdings BV 1,000 % éch. 20/12/2027 | € 5 000 | 5 079 | 0,05 | PORTUGAL OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS Banco Santander Totta S.A. 3,750 % éch. 11/09/2026 | 13 200 | 14 845 | 0,14 | Shinhan Financial Group Co. Ltd. 3,340 % éch. 05/02/2030 (i) | \$ 3 000 | 2 924 | 0,03 |
| 2,200 % éch. 23/11/2030 | \$ 6 735 | 5 423 | 0,05 | QATAR ÉMISSIONS SOUVERAINES Obligation internationale du gouvernement qatari 4,400 % éch. 16/04/2050 | \$ 11 100 | 10 254 | 0,10 | Total Espagne | | 35 498 | 0,33 |
| 2,250 % éch. 19/12/2039 | € 4 800 | 4 144 | 0,04 | ROUMANIE ÉMISSIONS SOUVERAINES Obligation internationale du gouvernement roumain 1,375 % éch. 02/12/2029 | € 2 984 | 2 723 | 0,02 | SUPRANATIONALES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS Banque européenne pour la reconstruction et le développement | \$ 5 200 | 5 017 | 0,05 |
| 5,000 % éch. 12/06/2033 | 3 300 | 3 937 | 0,04 | 1,750 % éch. 13/07/2030 | 7 650 | 6 854 | 0,06 | 1,500 % éch. 13/02/2025 | 400 | 390 | 0,00 |
| JDE Peet's NV 4,125 % éch. 23/01/2030 | 8 500 | 9 669 | 0,09 | 2,125 % éch. 07/03/2028 | 7 200 | 7 234 | 0,07 | 1,625 % éch. 27/09/2024 | | | |
| 4,500 % éch. 23/01/2034 | 21 200 | 24 652 | 0,23 | 2,625 % éch. 02/12/2040 | 22 600 | 16 854 | 0,16 | Banque européenne d'investissement 0,750 % éch. 15/11/2024 | £ 15 196 | 18 705 | 0,18 |
| LeasePlan Corp. NV 2,875 % éch. 24/10/2024 | \$ 1 020 | 997 | 0,01 | 2,875 % éch. 13/04/2042 | 8 200 | 6 152 | 0,06 | Total Supranationales | | 24 112 | 0,23 |
| 7,375 % éch. 29/05/2024 (g)(i) | € 1 000 | 1 111 | 0,01 | Total Roumanie | | 39 817 | 0,37 | SUÈDE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS Fastighets AB Balder 1,125 % éch. 29/01/2027 | € 4 500 | 4 263 | 0,04 |
| Lseg Netherlands BV 4,231 % éch. 29/09/2030 | 7 000 | 8 174 | 0,08 | RUSSIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS MMK International Capital DAC 4,375 % éch. 13/06/2024 ^ | \$ 4 900 | 294 | 0,00 | Sagax AB 1,125 % éch. 30/01/2027 | 4 200 | 4 181 | 0,04 |
| Nationale-Nederlanden Bank NV 3,625 % éch. 16/10/2026 | 3 400 | 3 835 | 0,04 | ARABIE SAOUDITE ÉMISSIONS SOUVERAINES Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite | | | | 2,250 % éch. 13/03/2025 | 8 400 | 9 035 | 0,08 |
| NE Property BV 1,875 % éch. 09/10/2026 | 3 500 | 3 540 | 0,03 | 2,250 % éch. 02/02/2033 | 18 705 | 15 529 | 0,15 | Total Suède | | 17 479 | 0,16 |
| 2,000 % éch. 20/01/2030 | 7 000 | 6 224 | 0,06 | 4,750 % éch. 18/01/2028 | 52 000 | 52 599 | 0,49 | SUISSE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS UBS AG 5,650 % éch. 11/09/2028 | \$ 12 500 | 12 972 | 0,12 |
| 3,375 % éch. 14/07/2027 | 9 111 | 9 528 | 0,09 | 4,875 % éch. 18/07/2033 | 25 000 | 25 567 | 0,24 | | | | |
| NN Group NV 4,625 % éch. 13/01/2048 | 2 000 | 2 223 | 0,02 | 5,000 % éch. 18/01/2053 | 6 000 | 5 665 | 0,05 | | | | |
| Prosus NV 1,539 % éch. 03/08/2028 | 3 700 | 3 537 | 0,03 | Total Arabie saoudite | | 99 360 | 0,93 | | | | |
| 2,031 % éch. 03/08/2032 | 25 387 | 21 512 | 0,20 | SINGAPOUR OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 1,832 % éch. 10/09/2030 (i) | 13 300 | 12 516 | 0,12 | | | | |
| 4,027 % éch. 03/08/2050 | \$ 3 800 | 2 497 | 0,02 | Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,750 % éch. 19/05/2033 | 4 687 | 4 699 | 0,04 | | | | |
| 4,193 % éch. 19/01/2032 | 3 800 | 3 281 | 0,03 | 5,110 % éch. 19/05/2043 | 18 100 | 18 047 | 0,17 | | | | |
| Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % éch. 26/01/2028 | € 5 817 | 5 500 | 0,05 | SP PowerAssets Ltd. 3,000 % éch. 26/09/2027 | 2 400 | 2 282 | 0,02 | | | | |
| (k) | | | | United Overseas Bank Ltd. 1,750 % éch. 16/03/2031 (i) | 3 500 | 3 231 | 0,03 | | | | |
| 1,000 % éch. 17/05/2029 | 1 400 | 1 267 | 0,01 | Total Singapour | | 40 775 | 0,38 | | | | |
| 1,625 % éch. 24/02/2026 | 5 900 | 6 185 | 0,06 | | | | | | | | |
| Sandoz Finance BV 3,970 % éch. 17/04/2027 | 7 400 | 8 344 | 0,08 | | | | | | | | |
| 4,220 % éch. 17/04/2030 | 600 | 689 | 0,01 | | | | | | | | |
| 4,500 % éch. 17/11/2033 | 700 | 822 | 0,01 | | | | | | | | |
| Siemens Energy Finance BV 4,250 % éch. 05/04/2029 | 3 300 | 3 566 | 0,03 | | | | | | | | |
| Syngenta Finance NV 4,892 % éch. 24/04/2025 | \$ 5 284 | 5 216 | 0,05 | | | | | | | | |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,150 % éch. 01/10/2026 | 6 000 | 5 560 | 0,05 | | | | | | | | |
| Volkswagen Financial Services NV 0,875 % éch. 20/02/2025 | £ 6 400 | 7 750 | 0,07 | | | | | | | | |
| 1,875 % éch. 03/12/2024 | 1 800 | 2 218 | 0,02 | | | | | | | | |
| Volkswagen International Finance NV 7,875 % éch. 06/09/2032 | € 2 900 | 3 614 | 0,03 | | | | | | | | |
| (g) | | | | | | | | | | | |
| Vonovia Finance BV 0,500 % éch. 14/09/2029 | 400 | 365 | 0,00 | | | | | | | | |
| 1,125 % éch. 14/09/2034 | 1 000 | 827 | 0,01 | | | | | | | | |
| | | 306 221 | 2,86 | | | | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | | | | | |
| EMF-NL Prime BV 4,785 % éch. 17/04/2041 | 343 | 364 | 0,00 | | | | | | | | |
| Eurosail BV 5,485 % éch. 17/10/2040 | 28 | 31 | 0,00 | | | | | | | | |
| | | 395 | 0,00 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| UBS Group AG | | | | 3,500 % éch. 26/07/2026 | \$ 21 311 | \$ 20 343 | 0,19 | 2,875 % éch. 24/06/2025 | € 6 700 | \$ 7 356 | 0,07 |
| 1,494 % éch. 10/08/2027 | \$ 5 000 | \$ 4 520 | 0,04 | 3,875 % éch. 26/07/2029 | 9 040 | 8 441 | 0,08 | 3,375 % éch. 24/04/2026 | £ 2 300 | 2 804 | 0,03 |
| 2,593 % éch. 11/09/2025 | 18 030 | 17 644 | 0,17 | 5,500 % éch. 28/09/2026 | £ 3 300 | 4 244 | 0,04 | 4,000 % éch. 03/09/2027 | 1 000 | 1 210 | 0,01 |
| 3,091 % éch. 14/05/2032 | 1 500 | 1 278 | 0,01 | Informa PLC | | | | 4,625 % éch. 29/10/2028 | € 389 | 429 | 0,00 |
| 3,126 % éch. 13/08/2030 | 400 | 357 | 0,00 | 1,250 % éch. 22/04/2028 | € 8 823 | 8 934 | 0,08 | Weir Group PLC | | | |
| 4,125 % éch. 24/09/2025 | 58 990 | 57 749 | 0,54 | 2,125 % éch. 06/10/2025 | 17 190 | 18 473 | 0,17 | 2,200 % éch. 13/05/2026 | \$ 8 500 | 7 907 | 0,07 |
| 4,750 % éch. 17/03/2032 | € 11 040 | 12 872 | 0,12 | 3,125 % éch. 05/07/2026 | £ 100 | 122 | 0,00 | | | 618 468 | 5,77 |
| 4,965 % éch. 16/01/2026 | 3 550 | 3 929 | 0,04 | InterContinental Hotels Group PLC | | | | | | | |
| 6,301 % éch. 22/09/2034 | \$ 3 100 | 3 284 | 0,03 | 1,625 % éch. 08/10/2024 | € 15 000 | 16 292 | 0,15 | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 5 000 | 6 373 | 0,06 | 3,375 % éch. 08/10/2028 | £ 7 572 | 9 010 | 0,08 | Canary Wharf Finance PLC | | | |
| 9,250 % éch. 13/11/2028 | | | | John Lewis PLC | | | | 5,952 % éch. 22/10/2037 | £ 55 | 72 | 0,00 |
| (g)(i) | \$ 5 800 | 6 272 | 0,06 | 4,250 % éch. 18/12/2034 | 2 800 | 2 597 | 0,03 | Great Hall Mortgages PLC | | | |
| 9,250 % éch. 13/11/2033 | | | | 6,125 % éch. 21/01/2025 | 1 950 | 2 481 | 0,02 | 5,812 % éch. 18/06/2039 | \$ 398 | 396 | 0,01 |
| (g)(i) | 4 200 | 4 665 | 0,04 | Lloyds Bank PLC | | | | Newgate Funding PLC | | | |
| Total Suisse | | 131 915 | 1,23 | 0,000 % éch. 02/04/2032 | \$ 24 400 | 15 776 | 0,15 | 5,509 % éch. 01/12/2050 | £ 111 | 137 | 0,00 |
| | | | | Lloyds Banking Group PLC | | | | RMAC PLC | | | |
| THAÏLANDE | | | | 4,947 % éch. 27/06/2025 | | | | 0,000 % éch. 15/02/2047 | 18 600 | 23 788 | 0,22 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | (g)(i) | € 5 200 | 5 617 | 0,05 | | | 24 393 | 0,23 |
| Bangkok Bank PCL | | | | M&G PLC | | | | Total Royaume-Uni | | 642 861 | 6,00 |
| 3,466 % éch. 23/09/2036 (i) | 9 000 | 7 561 | 0,07 | 6,340 % éch. 19/12/2063 | £ 500 | 611 | 0,01 | ÉTATS-UNIS | | | |
| | | | | Market Bidco Finco PLC | | | | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| TURQUIE | | | | 4,750 % éch. 04/11/2027 | € 11 381 | 11 306 | 0,11 | AASET Dossés | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Marks & Spencer PLC | | | | 3,967 % éch. 16/05/2042 | \$ 445 | 407 | 0,00 |
| Turkish Airlines Pass-Through Trust | | | | 3,750 % éch. 19/05/2026 | £ 100 | 124 | 0,00 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | |
| 4,200 % éch. 15/09/2028 | 3 644 | 3 452 | 0,03 | Mitchells & Butlers Finance PLC | | | | 6,370 % éch. 25/12/2034 | 960 | 869 | 0,01 |
| | | | | 5,789 % éch. 15/12/2030 | 535 | 630 | 0,01 | 6,415 % éch. 25/05/2035 | 1 900 | 1 710 | 0,02 |
| ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | 6,013 % éch. 15/12/2030 | 404 | 489 | 0,01 | Aegis Asset-Backed Securities Trust | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC | | | | 5,640 % éch. 25/01/2037 | 3 616 | 2 644 | 0,03 |
| DAE Sukuk Dfc Ltd. | | | | 3,530 % éch. 20/09/2028 | € 3 000 | 3 367 | 0,03 | Ameriqueq Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | |
| 3,750 % éch. 15/02/2026 | 8 183 | 7 876 | 0,07 | National Grid PLC | | | | 6,175 % éch. 25/01/2036 | 153 | 153 | 0,00 |
| | | | | 5,602 % éch. 12/06/2028 | \$ 1 400 | 1 444 | 0,01 | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | |
| ROYAUME-UNI | | | | 5,809 % éch. 12/06/2033 | 21 500 | 22 611 | 0,21 | 4,453 % éch. 25/08/2032 | 92 | 87 | 0,00 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Nationwide Building Society | | | | Fremont Home Loan Trust | | | |
| Barclays PLC | | | | 3,375 % éch. 27/11/2028 | € 1 600 | 1 811 | 0,02 | 5,790 % éch. 25/08/2036 | 6 862 | 2 208 | 0,02 |
| 2,645 % éch. 24/06/2031 | 8 000 | 6 752 | 0,06 | 4,500 % éch. 01/11/2026 | 7 300 | 8 322 | 0,08 | GSAMP Trust | | | |
| 4,918 % éch. 08/08/2030 | € 5 500 | 6 335 | 0,06 | 5,264 % éch. 10/11/2026 | \$ 500 | 510 | 0,01 | 5,640 % éch. 25/01/2037 | 1 193 | 1 156 | 0,01 |
| 5,501 % éch. 09/08/2028 | \$ 7 550 | 7 589 | 0,07 | 5,875 % éch. 20/12/2024 | | | | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | |
| 6,224 % éch. 09/05/2034 | 5 531 | 5 740 | 0,05 | (g)(i) | £ 8 150 | 10 223 | 0,10 | 5,660 % éch. 25/04/2037 | 4 562 | 2 949 | 0,03 |
| 6,490 % éch. 13/09/2029 | 7 500 | 7 816 | 0,07 | 6,557 % éch. 18/10/2027 | \$ 20 000 | 20 716 | 0,19 | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | |
| 6,692 % éch. 13/09/2034 | 7 800 | 8 344 | 0,08 | NatWest Group PLC | | | | 5,680 % éch. 25/10/2036 | 833 | 819 | 0,01 |
| 7,090 % éch. 06/11/2029 | £ 9 500 | 12 912 | 0,12 | 4,269 % éch. 22/03/2025 | 8 800 | 8 770 | 0,08 | L2L Education Loan Trust | | | |
| 8,000 % éch. 15/06/2024 | | | | 4,800 % éch. 05/04/2026 | 3 800 | 3 768 | 0,04 | 5,816 % éch. 15/06/2031 | 832 | 832 | 0,01 |
| (g)(i) | \$ 4 300 | 4 281 | 0,04 | 4,892 % éch. 18/05/2029 | 8 625 | 8 478 | 0,08 | Labrador Aviation Finance Ltd. | | | |
| BAT International Finance PLC | | | | 5,076 % éch. 27/01/2030 | 7 978 | 7 863 | 0,07 | 4,300 % éch. 15/01/2042 | 11 854 | 10 136 | 0,10 |
| 2,250 % éch. 26/06/2028 | £ 8 100 | 9 210 | 0,09 | 6,016 % éch. 02/03/2034 | 25 900 | 27 221 | 0,25 | Long Beach Mortgage Loan Trust | | | |
| BP Capital Markets PLC | | | | Quadgas Finance PLC | | | | 5,790 % éch. 25/12/2036 | 4 120 | 2 814 | 0,03 |
| 5,773 % éch. 25/05/2038 | 1 091 | 1 523 | 0,01 | 3,375 % éch. 17/09/2029 | £ 300 | 339 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/06/2035 | 4 166 | 4 019 | 0,04 |
| Broadgate Financing PLC | | | | Royalty Pharma PLC | | | | MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 4,851 % éch. 05/04/2033 | 49 | 64 | 0,00 | 2,200 % éch. 02/09/2030 | \$ 5 593 | 4 703 | 0,04 | 6,190 % éch. 25/12/2034 | 1 648 | 1 535 | 0,01 |
| Cadent Finance PLC | | | | 3,300 % éch. 02/09/2040 | 5 000 | 3 761 | 0,04 | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | |
| 2,625 % éch. 22/09/2038 | 300 | 278 | 0,00 | Sage Group PLC | | | | 6,520 % éch. 25/04/2035 | 1 485 | 1 407 | 0,01 |
| Chanel Ceres PLC | | | | 1,625 % éch. 25/02/2031 | £ 1 400 | 1 465 | 0,01 | New Century Home Equity Loan Trust | | | |
| 0,500 % éch. 31/07/2026 | € 11 800 | 12 157 | 0,11 | Santander UK Group Holdings PLC | | | | 6,400 % éch. 25/11/2034 | 212 | 208 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 31/07/2031 | 6 599 | 6 150 | 0,06 | 2,896 % éch. 15/03/2032 | \$ 500 | 427 | 0,00 | Option One Mortgage Loan Trust | | | |
| Clydesdale Bank PLC | | | | 2,920 % éch. 08/05/2026 | £ 2 700 | 3 294 | 0,03 | 5,610 % éch. 25/01/2037 | 4 418 | 2 506 | 0,02 |
| 5,820 % éch. 22/09/2028 | £ 8 500 | 10 837 | 0,10 | 3,530 % éch. 25/08/2028 | € 2 000 | 2 195 | 0,02 | Residential Asset Mortgage Products Trust | | | |
| Direct Line Insurance Group PLC | | | | 6,750 % éch. 24/06/2024 | | | | 0,000 % éch. 25/12/2035 | 379 | 313 | 0,00 |
| 4,000 % éch. 05/06/2032 | 1 200 | 1 249 | 0,01 | (g)(i) | £ 12 950 | 16 523 | 0,16 | Residential Asset Securities Corp. Trust | | | |
| DWR Cymru Financing UK PLC | | | | 7,482 % éch. 29/08/2029 | 8 900 | 12 348 | 0,12 | 6,130 % éch. 25/11/2035 | 143 | 143 | 0,00 |
| 3,514 % éch. 31/03/2030 | 33 | 47 | 0,00 | Santander UK PLC | | | | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | |
| Ferguson Finance PLC | | | | 5,770 % éch. 12/02/2027 | 11 800 | 15 069 | 0,14 | 6,050 % éch. 25/12/2035 | 350 | 337 | 0,00 |
| 3,250 % éch. 02/06/2030 | \$ 4 300 | 3 850 | 0,04 | Standard Chartered PLC | | | | 6,145 % éch. 25/01/2035 | 89 | 78 | 0,00 |
| Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC | | | | 1,456 % éch. 14/01/2027 | \$ 16 100 | 14 758 | 0,14 | SLM Private Credit Student Loan Trust | | | |
| 3,250 % éch. 25/02/2030 | 7 700 | 4 504 | 0,04 | 2,819 % éch. 30/01/2026 | 2 300 | 2 225 | 0,02 | 5,886 % éch. 16/12/2041 | 1 238 | 1 203 | 0,01 |
| Greene King Finance PLC | | | | 3,265 % éch. 18/02/2036 | 5 700 | 4 671 | 0,04 | Soundview Home Loan Trust | | | |
| 0,000 % éch. 15/03/2036 | £ 900 | 907 | 0,01 | 3,603 % éch. 12/01/2033 | 5 900 | 4 893 | 0,05 | 5,930 % éch. 25/06/2036 | 3 569 | 3 402 | 0,03 |
| 4,064 % éch. 15/03/2035 | 4 307 | 5 022 | 0,05 | 4,644 % éch. 01/04/2031 | 2 700 | 2 547 | 0,02 | Structured Asset Investment Loan Trust | | | |
| 5,106 % éch. 15/03/2034 | 86 | 106 | 0,00 | 6,296 % éch. 06/07/2034 | 600 | 631 | 0,01 | 6,090 % éch. 25/01/2036 | 3 489 | 3 212 | 0,03 |
| 5,318 % éch. 15/09/2031 | 213 | 266 | 0,00 | 6,301 % éch. 09/01/2029 | 11 533 | 11 845 | 0,11 | | | 45 147 | 0,42 |
| HSBC Holdings PLC | | | | SW Finance PLC | | | | | | | |
| 1,750 % éch. 24/07/2027 | 19 060 | 22 335 | 0,21 | 7,375 % éch. 12/12/2041 | £ 7 000 | 9 580 | 0,09 | | | | |
| 2,357 % éch. 18/08/2031 | \$ 5 539 | 4 592 | 0,04 | Telereal Secured Finance PLC | | | | | | | |
| 2,848 % éch. 04/06/2031 | 8 500 | 7 316 | 0,07 | 4,010 % éch. 10/12/2033 | 213 | 257 | 0,00 | | | | |
| 3,973 % éch. 22/05/2030 | 11 300 | 10 564 | 0,10 | Thames Water Utilities Finance PLC | | | | | | | |
| 4,041 % éch. 13/03/2028 | 17 400 | 16 774 | 0,16 | 4,375 % éch. 18/01/2031 | € 3 000 | 3 142 | 0,03 | | | | |
| 4,292 % éch. 12/09/2026 | 2 500 | 2 450 | 0,02 | 8,250 % éch. 25/04/2040 | £ 6 225 | 8 926 | 0,08 | | | | |
| 4,600 % éch. 17/12/2030 | | | | TP ICAP Finance PLC | | | | | | | |
| (g)(i) | 11 900 | 9 954 | 0,09 | 2,625 % éch. 18/11/2028 | 5 568 | 5 946 | 0,06 | | | | |
| Imperial Brands Finance PLC | | | | 5,250 % éch. 29/05/2026 | 16 900 | 20 893 | 0,20 | | | | |
| 3,125 % éch. 26/07/2024 | 1 300 | 1 279 | 0,01 | 7,875 % éch. 17/04/2030 | 4 800 | 6 527 | 0,06 | | | | |
| | | | | Virgin Money UK PLC | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-----------|----------------------------|---------------------|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| ACTIONS ORDINAIRES SERVICES FINANCIERS | | | | | | | | | | | |
| Stearns Holdings LLC « B » (c) | 1 508 783 | \$ 0 | 0,00 | 5,450 % éch. 23/01/2039 | \$ 7 000 | \$ 7 388 | 0,07 | Booz Allen Hamilton, Inc. 5,950 % éch. 04/08/2033 | \$ 2 900 | \$ 3 067 | 0,03 |
| | | | | Antares Holdings LP 2,750 % éch. 15/01/2027 | 5 800 | 5 143 | 0,05 | Boston Gas Co. 6,119 % éch. 20/07/2053 | 3 000 | 3 137 | 0,03 |
| | | | | 3,950 % éch. 15/07/2026 | 3 500 | 3 258 | 0,03 | Boston Scientific Corp. 2,650 % éch. 01/06/2030 | 5 749 | 5 136 | 0,05 |
| | | | | 7,950 % éch. 11/08/2028 | 5 000 | 5 181 | 0,05 | Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % éch. 15/11/2027 | 1 450 | 1 297 | 0,01 |
| | | | | Apple, Inc. 4,300 % éch. 10/05/2033 (k) | 2 200 | 2 235 | 0,02 | British Airways Pass-Through Trust 3,300 % éch. 15/06/2034 | 11 321 | 10 086 | 0,09 |
| | | | | Ares Capital Corp. 2,875 % éch. 15/06/2027 | 8 400 | 7 681 | 0,07 | 3,350 % éch. 15/12/2030 | 724 | 656 | 0,01 |
| | | | | Ares Finance Co. LLC 3,250 % éch. 15/06/2030 | 15 444 | 13 664 | 0,13 | 3,800 % éch. 20/03/2033 | 64 | 60 | 0,00 |
| | | | | Ares Management Corp. 6,375 % éch. 10/11/2028 | 14 000 | 14 688 | 0,14 | 4,125 % éch. 20/03/2033 | 65 | 59 | 0,00 |
| | | | | Ashtead Capital, Inc. 1,500 % éch. 12/08/2026 | 1 200 | 1 089 | 0,01 | 4,250 % éch. 15/05/2034 | 650 | 607 | 0,01 |
| | | | | 4,000 % éch. 01/05/2028 | 7 041 | 6 633 | 0,06 | 4,625 % éch. 20/12/2025 | 311 | 310 | 0,00 |
| | | | | Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc. 6,125 % éch. 09/09/2028 | 3 900 | 4 098 | 0,04 | Broadcom, Inc. 2,450 % éch. 15/02/2031 | 12 900 | 11 038 | 0,10 |
| | | | | AT&T, Inc. 3,550 % éch. 15/09/2055 | 7 171 | 5 161 | 0,05 | 3,187 % éch. 15/11/2036 | 34 991 | 28 374 | 0,26 |
| | | | | 3,650 % éch. 15/09/2059 | 15 243 | 10 938 | 0,10 | 3,469 % éch. 15/04/2034 | 18 649 | 16 233 | 0,15 |
| | | | | 4,300 % éch. 18/11/2034 | € 3 400 | 3 978 | 0,04 | 3,500 % éch. 15/02/2041 | 200 | 159 | 0,00 |
| | | | | Atmos Energy Corp. 5,900 % éch. 15/11/2033 | \$ 1 000 | 1 086 | 0,01 | 4,926 % éch. 15/05/2037 | 11 422 | 11 061 | 0,10 |
| | | | | Aviation Capital Group LLC 3,500 % éch. 01/11/2027 | 8 030 | 7 406 | 0,07 | Brookfield Capital Finance LLC 6,087 % éch. 14/06/2033 | 7 700 | 8 041 | 0,08 |
| | | | | 4,375 % éch. 30/01/2024 | 13 999 | 13 977 | 0,13 | Brooklyn Union Gas Co. 3,865 % éch. 04/03/2029 | 204 | 189 | 0,00 |
| | | | | Bank of America Corp. 0,580 % éch. 08/08/2029 | € 9 500 | 9 225 | 0,09 | Burlington Northern Santa Fe LLC 4,450 % éch. 15/01/2053 | 344 | 325 | 0,00 |
| | | | | 1,898 % éch. 23/07/2031 | \$ 4 200 | 3 438 | 0,03 | 5,200 % éch. 15/04/2054 | 10 828 | 11 282 | 0,11 |
| | | | | 2,551 % éch. 04/02/2028 | 26 100 | 24 191 | 0,23 | Cameron LNG LLC 2,902 % éch. 15/07/2031 | 1 900 | 1 668 | 0,02 |
| | | | | 2,592 % éch. 29/04/2031 | 15 000 | 12 935 | 0,12 | 3,402 % éch. 15/01/2038 | 4 172 | 3 526 | 0,03 |
| | | | | 2,651 % éch. 11/03/2032 | 10 000 | 8 449 | 0,08 | 3,701 % éch. 15/01/2039 | 8 325 | 7 066 | 0,07 |
| | | | | 2,687 % éch. 22/04/2032 | 1 710 | 1 445 | 0,01 | Cantor Fitzgerald LP 4,500 % éch. 14/04/2027 | 100 | 96 | 0,00 |
| | | | | 3,093 % éch. 01/10/2025 | 8 019 | 8 827 | 0,08 | 4,875 % éch. 01/05/2024 | 3 500 | 3 474 | 0,03 |
| | | | | 4,271 % éch. 23/07/2029 | 9 300 | 2 222 | 0,02 | 7,200 % éch. 12/12/2028 | 7 900 | 8 105 | 0,08 |
| | | | | 4,300 % éch. 28/01/2025 (g) | 27 900 | 26 305 | 0,25 | Capital One Financial Corp. 6,312 % éch. 08/06/2029 | 9 621 | 9 875 | 0,09 |
| | | | | 4,827 % éch. 22/07/2026 | 1 700 | 1 688 | 0,02 | Carlyle Holdings Finance LLC 5,625 % éch. 30/03/2043 | 100 | 98 | 0,00 |
| | | | | 5,015 % éch. 22/07/2033 | 5 000 | 4 948 | 0,05 | Carrier Global Corp. 4,375 % éch. 29/05/2025 | € 13 400 | 14 936 | 0,14 |
| | | | | 5,288 % éch. 25/04/2034 | 14 600 | 14 641 | 0,14 | 5,800 % éch. 30/11/2025 | \$ 5 000 | 5 069 | 0,05 |
| | | | | 5,819 % éch. 15/09/2029 | 11 200 | 11 568 | 0,11 | CDW LLC 3,569 % éch. 01/12/2031 | 6 400 | 5 684 | 0,05 |
| | | | | 5,872 % éch. 15/09/2034 | 1 250 | 1 309 | 0,01 | Centene Corp. 2,450 % éch. 15/07/2028 | 20 384 | 18 169 | 0,17 |
| | | | | 5,933 % éch. 15/09/2027 | 5 000 | 5 104 | 0,05 | 3,000 % éch. 15/10/2030 | 21 000 | 18 213 | 0,17 |
| | | | | Bank of America N.A. 5,526 % éch. 18/08/2026 | 22 300 | 22 719 | 0,21 | Charles Schwab Corp. 6,196 % éch. 17/11/2029 | 20 300 | 21 300 | 0,20 |
| | | | | 5,650 % éch. 18/08/2025 | 5 825 | 5 899 | 0,06 | Charter Communications Operating LLC 2,250 % éch. 15/01/2029 | 7 920 | 6 876 | 0,06 |
| | | | | 6,000 % éch. 15/10/2036 | 7 150 | 7 760 | 0,07 | 2,300 % éch. 01/02/2032 | 11 000 | 8 762 | 0,08 |
| | | | | BAT Capital Corp. 2,726 % éch. 25/03/2031 | 2 894 | 2 429 | 0,02 | 3,500 % éch. 01/06/2041 | 9 200 | 6 511 | 0,06 |
| | | | | 6,421 % éch. 02/08/2033 | 1 300 | 1 361 | 0,01 | 3,700 % éch. 01/04/2051 | 6 800 | 4 430 | 0,04 |
| | | | | Bayer U.S. Finance LLC 4,250 % éch. 15/12/2025 | 400 | 390 | 0,00 | 3,900 % éch. 01/06/2052 | 1 700 | 1 145 | 0,01 |
| | | | | 4,375 % éch. 15/12/2028 | 22 280 | 21 193 | 0,20 | 4,400 % éch. 01/12/2061 | 750 | 519 | 0,00 |
| | | | | 6,375 % éch. 21/11/2030 | 15 500 | 15 959 | 0,15 | 4,800 % éch. 01/03/2050 | 8 400 | 6 513 | 0,06 |
| | | | | Becton Dickinson & Co. 0,034 % éch. 13/08/2025 | € 2 300 | 2 408 | 0,02 | 5,125 % éch. 01/07/2049 | 12 300 | 10 005 | 0,09 |
| | | | | Berry Global, Inc. 1,000 % éch. 15/01/2025 | 9 900 | 10 631 | 0,10 | 5,375 % éch. 01/04/2038 | 5 632 | 5 086 | 0,05 |
| | | | | 1,500 % éch. 15/01/2027 | 9 100 | 9 439 | 0,09 | 6,150 % éch. 10/11/2026 | 4 500 | 4 602 | 0,04 |
| | | | | 4,875 % éch. 15/07/2026 | \$ 2 870 | 2 822 | 0,03 | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 3,700 % éch. 15/11/2029 | 8 332 | 7 875 | 0,07 |
| | | | | BGC Group, Inc. 8,000 % éch. 25/05/2028 | 5 500 | 5 747 | 0,05 | 5,125 % éch. 30/06/2027 | 13 132 | 13 205 | 0,12 |
| | | | | Black Hills Corp. 1,037 % éch. 23/08/2024 | 1 100 | 1 068 | 0,01 | Cheniere Energy Partners LP 3,250 % éch. 31/01/2032 | 8 600 | 7 338 | 0,07 |
| | | | | 5,950 % éch. 15/03/2028 | 2 990 | 3 100 | 0,03 | 4,000 % éch. 01/03/2031 | 16 200 | 14 750 | 0,14 |
| | | | | 6,150 % éch. 15/05/2034 | 2 500 | 2 607 | 0,02 | 5,950 % éch. 30/06/2033 | 9 900 | 10 177 | 0,10 |
| | | | | Blackstone Private Credit Fund 2,350 % éch. 22/11/2024 | 12 969 | 12 551 | 0,12 | Cheniere Energy, Inc. 4,625 % éch. 15/10/2028 | 3 600 | 3 517 | 0,03 |
| | | | | Blue Owl Finance LLC 3,125 % éch. 10/06/2031 | 5 700 | 4 703 | 0,04 | Choice Hotels International, Inc. 3,700 % éch. 01/12/2029 | 1 700 | 1 508 | 0,01 |
| | | | | Boeing Co. 2,196 % éch. 04/02/2026 | 23 500 | 22 209 | 0,21 | Citibank N.A. 5,803 % éch. 29/09/2028 | 7 650 | 7 993 | 0,07 |
| | | | | 3,250 % éch. 01/02/2028 | 4 400 | 4 177 | 0,04 | 5,864 % éch. 29/09/2025 | 10 000 | 10 170 | 0,10 |
| | | | | 5,150 % éch. 01/05/2030 | 1 137 | 1 158 | 0,01 | Citigroup, Inc. 2,572 % éch. 03/06/2031 (j) | 24 439 | 20 889 | 0,20 |
| | | | | 5,930 % éch. 01/05/2060 | 5 000 | 5 186 | 0,05 | | | | |
| | | | | Booking Holdings, Inc. 4,125 % éch. 12/05/2033 | € 1 900 | 2 245 | 0,02 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Cleveland Electric Illuminating Co. 3,500 % éch. 01/04/2028 | \$ 2 965 | \$ 2 779 | 0,03 | Duke Energy Indiana LLC 5,400 % éch. 01/04/2053 | \$ 1 218 | \$ 1 243 | 0,01 | Glencore Funding LLC 5,400 % éch. 08/05/2028 | \$ 500 | \$ 510 | 0,00 |
| CNA Financial Corp. 5,500 % éch. 15/06/2033 | 1 000 | 1 032 | 0,01 | Duke Energy Ohio, Inc. 5,650 % éch. 01/04/2053 | 1 868 | 1 961 | 0,02 | Global Payments, Inc. 4,875 % éch. 17/03/2031 | € 8 600 | 9 998 | 0,09 |
| Columbia Pipelines Holding Co. LLC 6,042 % éch. 15/08/2028 | 3 400 | 3 512 | 0,03 | Duke Energy Progress LLC 5,250 % éch. 15/03/2033 | 5 283 | 5 449 | 0,05 | GLP Capital LP 4,000 % éch. 15/01/2030 | 1 500 | 1 370 | 0,01 |
| Columbia Pipelines Operating Co. LLC 5,927 % éch. 15/08/2030 | 2 300 | 2 380 | 0,02 | Edison International 8,125 % éch. 15/06/2053 | 1 230 | 1 259 | 0,01 | 4,000 % éch. 15/01/2031 | 4 000 | 3 607 | 0,03 |
| 6,036 % éch. 15/11/2033 | 13 500 | 14 145 | 0,13 | Enel Finance America LLC 7,100 % éch. 14/10/2027 | 2 600 | 2 776 | 0,03 | 5,300 % éch. 15/01/2029 | 15 224 | 15 145 | 0,14 |
| Comcast Corp. 5,350 % éch. 15/05/2053 | 12 889 | 13 344 | 0,12 | Energy Transfer LP 4,400 % éch. 15/03/2027 | 6 745 | 6 599 | 0,06 | 5,375 % éch. 15/04/2026 | 5 600 | 5 569 | 0,05 |
| ConocoPhillips Co. 5,050 % éch. 15/09/2033 | 12 000 | 12 335 | 0,12 | 5,150 % éch. 01/02/2043 | 2 294 | 2 046 | 0,02 | 5,750 % éch. 01/06/2028 | 13 929 | 14 065 | 0,13 |
| Constellation Energy Generation LLC 5,600 % éch. 01/03/2028 | 1 500 | 1 546 | 0,01 | 5,150 % éch. 15/03/2045 | 7 503 | 6 896 | 0,06 | Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % éch. 21/07/2032 | 4 100 | 3 370 | 0,03 |
| 5,750 % éch. 01/10/2041 | 2 500 | 2 500 | 0,02 | 5,300 % éch. 01/04/2044 | 4 130 | 3 809 | 0,04 | 2,600 % éch. 07/02/2030 | 4 187 | 3 681 | 0,03 |
| 6,125 % éch. 15/01/2034 | 2 500 | 2 677 | 0,03 | 5,350 % éch. 15/05/2045 | 7 181 | 6 685 | 0,06 | 3,272 % éch. 29/09/2025 | 15 500 | 15 240 | 0,14 |
| Consumers Securitization Funding LLC 5,550 % éch. 01/03/2028 | 1 000 | 1 005 | 0,01 | 6,050 % éch. 01/12/2026 | 4 200 | 4 321 | 0,04 | 4,223 % éch. 01/05/2029 | 19 400 | 18 779 | 0,18 |
| Continental Resources, Inc. 2,875 % éch. 01/04/2032 | 15 595 | 12 664 | 0,12 | 7,500 % éch. 01/07/2038 | 5 257 | 6 094 | 0,06 | 4,482 % éch. 23/08/2028 | 17 300 | 17 002 | 0,16 |
| 5,750 % éch. 15/01/2031 | 170 | 169 | 0,00 | Entergy Louisiana LLC 3,780 % éch. 01/04/2025 | 25 100 | 24 662 | 0,23 | 6,484 % éch. 24/10/2029 | 31 500 | 33 446 | 0,31 |
| Corporate Office Properties LP 2,250 % éch. 15/03/2026 | 5 100 | 4 759 | 0,04 | Entergy Mississippi LLC 5,000 % éch. 01/09/2033 | 1 000 | 1 008 | 0,01 | 6,811 % éch. 15/05/2026 | 14 800 | 14 899 | 0,14 |
| CoStar Group, Inc. 2,800 % éch. 15/07/2030 | 5 100 | 4 340 | 0,04 | Enterprise Products Operating LLC 5,250 % éch. 16/08/2077 | 4 739 | 4 542 | 0,04 | 7,250 % éch. 10/04/2028 | £ 3 817 | 5 330 | 0,05 |
| Cox Communications, Inc. 5,450 % éch. 15/09/2028 | 3 385 | 3 457 | 0,03 | 5,375 % éch. 15/02/2078 | 5 614 | 5 046 | 0,05 | Golub Capital BDC, Inc. 7,050 % éch. 05/12/2028 | \$ 3 000 | 3 148 | 0,03 |
| Credit Acceptance Corp. 9,250 % éch. 15/12/2028 | 2 300 | 2 455 | 0,02 | 8,638 % éch. 16/08/2077 | 5 838 | 5 812 | 0,05 | Goodman U.S. Finance Four LLC 4,500 % éch. 15/10/2037 | 7 182 | 6 144 | 0,06 |
| Credit Suisse AG AT1 Claim | 22 000 | 2 640 | 0,02 | EPR Properties 4,500 % éch. 01/04/2025 | 4 420 | 4 339 | 0,04 | Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % éch. 15/03/2028 | 15 779 | 14 702 | 0,14 |
| Crown Castle Towers LLC 4,241 % éch. 15/07/2048 | 5 800 | 5 508 | 0,05 | 4,500 % éch. 01/06/2027 | 6 264 | 5 915 | 0,06 | Guardian Life Global Funding 1,100 % éch. 23/06/2025 | 3 000 | 2 833 | 0,03 |
| Crown Castle, Inc. 2,250 % éch. 15/01/2031 | 12 500 | 10 359 | 0,10 | 4,750 % éch. 15/12/2026 | 4 425 | 4 237 | 0,04 | Gulfstream Natural Gas System LLC 4,600 % éch. 15/09/2025 | 4 560 | 4 478 | 0,04 |
| 3,100 % éch. 15/11/2029 | 10 305 | 9 230 | 0,09 | 4,950 % éch. 15/04/2028 | 1 986 | 1 886 | 0,02 | Haleon U.S. Capital LLC 3,625 % éch. 24/03/2032 | 500 | 461 | 0,00 |
| 3,800 % éch. 15/02/2028 | 3 765 | 3 579 | 0,03 | Equifax, Inc. 5,100 % éch. 01/06/2028 | 7 800 | 7 870 | 0,07 | Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % éch. 15/04/2026 | 740 | 727 | 0,01 |
| 4,300 % éch. 15/02/2029 | 3 597 | 3 466 | 0,03 | Equitable Financial Life Global Funding 1,300 % éch. 12/07/2026 | 1 000 | 902 | 0,01 | HAT Holdings LLC 8,000 % éch. 15/06/2027 | 3 950 | 4 118 | 0,04 |
| CVS Health Corp. 5,000 % éch. 30/01/2029 | 7 000 | 7 132 | 0,07 | Evergy Missouri West, Inc. 5,150 % éch. 15/12/2027 | 2 000 | 2 014 | 0,02 | HCA, Inc. 3,500 % éch. 01/09/2030 | 7 475 | 6 778 | 0,06 |
| 5,250 % éch. 30/01/2031 | 18 900 | 19 396 | 0,18 | Eversource Energy 5,125 % éch. 15/05/2033 | 8 300 | 8 349 | 0,08 | 3,500 % éch. 15/07/2051 | 3 800 | 2 681 | 0,03 |
| 5,875 % éch. 01/06/2053 | 6 500 | 6 845 | 0,06 | 5,950 % éch. 01/02/2029 | 2 000 | 2 096 | 0,02 | 4,125 % éch. 15/06/2029 | 3 100 | 2 966 | 0,03 |
| CVS Pass-Through Trust 4,704 % éch. 10/01/2036 | 202 | 187 | 0,00 | Exelon Corp. 4,050 % éch. 15/04/2030 | 3 417 | 3 262 | 0,03 | 4,500 % éch. 15/02/2027 | 3 800 | 3 757 | 0,04 |
| 5,926 % éch. 10/01/2034 | 1 860 | 1 886 | 0,02 | Expedia Group, Inc. 3,250 % éch. 15/02/2030 | 6 708 | 6 153 | 0,06 | 5,500 % éch. 01/06/2033 | 22 127 | 22 484 | 0,21 |
| 6,036 % éch. 10/12/2028 | 1 008 | 1 019 | 0,01 | 3,800 % éch. 15/02/2028 | 10 805 | 10 426 | 0,10 | HEICO Corp. 5,350 % éch. 01/08/2033 | 1 000 | 1 024 | 0,01 |
| 7,507 % éch. 10/01/2032 | 1 032 | 1 086 | 0,01 | 6,250 % éch. 01/05/2025 | 983 | 993 | 0,01 | Highwoods Realty LP 2,600 % éch. 01/02/2031 | 6 700 | 5 216 | 0,05 |
| 8,353 % éch. 10/07/2031 | 219 | 237 | 0,00 | Extra Space Storage LP 5,900 % éch. 15/01/2031 | 2 800 | 2 924 | 0,03 | 4,200 % éch. 15/04/2029 | 2 500 | 2 265 | 0,02 |
| DAE Funding LLC 1,550 % éch. 01/08/2024 | 6 333 | 6 171 | 0,06 | Fells Point Funding Trust 3,046 % éch. 31/01/2027 | 6 150 | 5 799 | 0,05 | Host Hotels & Resorts LP 2,900 % éch. 15/12/2031 | 2 173 | 1 825 | 0,02 |
| 1,625 % éch. 15/02/2024 | 3 100 | 3 084 | 0,03 | FirstEnergy Transmission LLC 4,550 % éch. 01/04/2049 | 2 083 | 1 807 | 0,02 | 3,375 % éch. 15/12/2029 | 4 700 | 4 224 | 0,04 |
| 3,375 % éch. 20/03/2028 | 24 600 | 22 706 | 0,21 | Fiserv, Inc. 3,000 % éch. 01/07/2031 | £ 800 | 916 | 0,01 | 3,500 % éch. 15/09/2030 | 2 600 | 2 322 | 0,02 |
| Daimler Truck Finance North America LLC 1,625 % éch. 13/12/2024 | 2 900 | 2 796 | 0,03 | Flex Intermediate Holdco LLC 3,363 % éch. 30/06/2031 | \$ 33 661 | 27 577 | 0,26 | 3,875 % éch. 01/04/2024 | 8 200 | 8 157 | 0,08 |
| 2,000 % éch. 14/12/2026 | 7 360 | 6 774 | 0,06 | Ford Foundation 2,815 % éch. 01/06/2070 | 1 600 | 1 022 | 0,01 | 4,000 % éch. 15/06/2025 | 1 625 | 1 588 | 0,01 |
| Dell International LLC 4,900 % éch. 01/10/2026 | 11 010 | 11 032 | 0,10 | Ford Motor Credit Co. LLC 2,330 % éch. 25/11/2025 | € 5 450 | 5 852 | 0,05 | Howard Midstream Energy Partners LLC 8,875 % éch. 15/07/2028 | 1 000 | 1 051 | 0,01 |
| 6,020 % éch. 15/06/2026 | 12 036 | 12 324 | 0,12 | 3,021 % éch. 06/03/2024 | 13 290 | 14 639 | 0,14 | Hudson Pacific Properties LP 3,250 % éch. 15/01/2030 | 2 325 | 1 710 | 0,02 |
| Delta Air Lines, Inc. 2,900 % éch. 28/10/2024 | 14 442 | 14 068 | 0,13 | 3,250 % éch. 15/09/2025 | 1 400 | 1 528 | 0,01 | 3,950 % éch. 01/11/2027 | 3 500 | 2 934 | 0,03 |
| 3,750 % éch. 28/10/2029 | 18 900 | 17 319 | 0,16 | 4,535 % éch. 06/03/2025 | £ 2 607 | 3 278 | 0,03 | 4,650 % éch. 01/04/2029 | 2 700 | 2 194 | 0,02 |
| Discovery Communications LLC 2,500 % éch. 20/09/2024 | £ 2 400 | 2 992 | 0,03 | 4,675 % éch. 01/12/2024 | € 3 187 | 3 529 | 0,03 | 5,950 % éch. 15/02/2028 | 2 200 | 1 947 | 0,02 |
| DISH DBS Corp. 5,250 % éch. 01/12/2026 | \$ 3 000 | 2 576 | 0,02 | 7,350 % éch. 06/03/2030 | \$ 4 600 | 4 945 | 0,05 | Humana, Inc. 4,875 % éch. 01/04/2030 | 1 000 | 1 014 | 0,01 |
| 5,750 % éch. 01/12/2028 | 3 100 | 2 478 | 0,02 | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 7,875 % éch. 01/12/2030 | 7 500 | 7 820 | 0,07 | 5,875 % éch. 01/03/2033 | 5 895 | 6 283 | 0,06 |
| Doctors Co. An Interinsurance Exchange 4,500 % éch. 18/01/2032 | 900 | 718 | 0,01 | Freedom Mortgage Corp. 12,000 % éch. 01/10/2028 | 5 800 | 6 339 | 0,06 | Hyundai Capital America 0,875 % éch. 14/06/2024 | 12 010 | 11 739 | 0,11 |
| DTE Electric Co. 1,900 % éch. 01/04/2028 | 4 600 | 4 142 | 0,04 | FS KKR Capital Corp. 1,650 % éch. 12/10/2024 | 9 700 | 9 362 | 0,09 | 1,500 % éch. 15/06/2026 | 9 947 | 9 088 | 0,08 |
| 5,200 % éch. 01/04/2033 | 3 500 | 3 639 | 0,03 | 2,625 % éch. 15/01/2027 | 5 211 | 4 683 | 0,04 | 6,000 % éch. 11/07/2025 | 1 200 | 1 210 | 0,01 |
| Duke Energy Carolinas LLC 4,000 % éch. 30/09/2042 | 122 | 105 | 0,00 | 7,875 % éch. 15/01/2029 | 600 | 636 | 0,01 | 6,532 % éch. 04/08/2025 | 10 000 | 9 998 | 0,09 |
| Duke Energy Corp. 3,850 % éch. 15/06/2034 | € 16 000 | 17 535 | 0,16 | Georgia Power Co. 3,250 % éch. 15/03/2051 | 200 | 145 | 0,00 | Illumina, Inc. 5,750 % éch. 13/12/2027 | 2 000 | 2 054 | 0,02 |
| 4,300 % éch. 15/03/2028 | \$ 3 613 | 3 565 | 0,03 | 4,950 % éch. 17/05/2033 | 5 000 | 5 044 | 0,05 | Infor, Inc. 1,750 % éch. 15/07/2025 | 4 575 | 4 316 | 0,04 |
| | | | | | | | | Integrus Baptist Medical Center, Inc. 3,875 % éch. 15/08/2050 | 8 200 | 6 302 | 0,06 |
| | | | | | | | | Intercontinental Exchange, Inc. 3,000 % éch. 15/09/2060 | 9 350 | 6 333 | 0,06 |
| | | | | | | | | Invitation Homes Operating Partnership LP 4,150 % éch. 15/04/2032 | 1 500 | 1 380 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,450 % éch. 15/08/2030 | \$ 3 400 | \$ 3 430 | 0,03 | MetLife, Inc. | | | | OneMain Finance Corp. | \$ 2 800 | \$ 2 837 | 0,03 |
| 5,500 % éch. 15/08/2033 | 1 500 | 1 504 | 0,01 | 5,875 % éch. 15/03/2028 (g) | \$ 7 079 | \$ 6 956 | 0,06 | 6,875 % éch. 15/03/2025 | 4 900 | 5 048 | 0,05 |
| Ipalco Enterprises, Inc. | | | | Metropolitan Edison Co. | 6 300 | 6 152 | 0,06 | 7,875 % éch. 15/03/2030 | | | |
| 3,700 % éch. 01/09/2024 | 2 858 | 2 814 | 0,03 | 4,000 % éch. 15/04/2025 | | | | ONEOK, Inc. | | | |
| 4,250 % éch. 01/05/2030 | 200 | 185 | 0,00 | Mid-America Apartments LP | | | | 4,350 % éch. 15/03/2029 | 21 030 | 20 455 | 0,19 |
| Jackson National Life Global Funding | | | | 1,100 % éch. 15/09/2026 | 2 600 | 2 360 | 0,02 | 6,050 % éch. 01/09/2033 | 12 300 | 13 038 | 0,12 |
| 2,650 % éch. 21/06/2024 | 600 | 589 | 0,01 | 3,600 % éch. 01/06/2027 | 1 811 | 1 752 | 0,02 | 6,625 % éch. 01/09/2053 | 17 000 | 19 047 | 0,18 |
| Jefferies Financial Group, Inc. | | | | 3,950 % éch. 15/03/2029 | 1 857 | 1 806 | 0,02 | Oracle Corp. | | | |
| 5,875 % éch. 21/07/2028 | 3 325 | 3 411 | 0,03 | Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC | | | | 3,600 % éch. 01/04/2040 | 9 300 | 7 424 | 0,07 |
| Jersey Central Power & Light Co. | | | | 4,100 % éch. 15/05/2028 | 7 140 | 6 901 | 0,06 | 3,600 % éch. 01/04/2050 | 500 | 371 | 0,00 |
| 4,300 % éch. 15/01/2026 | 880 | 862 | 0,01 | MidAmerican Energy Co. | | | | 3,850 % éch. 01/04/2060 | 1 345 | 977 | 0,01 |
| 4,700 % éch. 01/04/2024 | 3 800 | 3 787 | 0,04 | 3,950 % éch. 01/08/2047 | 4 903 | 4 115 | 0,04 | 4,100 % éch. 25/03/2061 (j) | 6 600 | 5 040 | 0,05 |
| JetBlue Pass-Through Trust | | | | 5,750 % éch. 01/11/2035 | 2 200 | 2 355 | 0,02 | 6,150 % éch. 09/11/2029 (j) | 10 000 | 10 765 | 0,10 |
| 4,000 % éch. 15/05/2034 | 884 | 812 | 0,01 | Midwest Connector Capital Co. LLC | | | | 6,250 % éch. 09/11/2032 (j) | 24 500 | 26 663 | 0,25 |
| JPMorgan Chase & Co. | | | | 3,900 % éch. 01/04/2024 | 29 977 | 29 811 | 0,28 | Organon & Co. | € 2 300 | 2 340 | 0,02 |
| 2,069 % éch. 01/06/2029 | 6 600 | 5 855 | 0,05 | Mileage Plus Holdings LLC | | | | 2,875 % éch. 30/04/2028 | | | |
| 2,301 % éch. 15/10/2025 | 33 500 | 32 650 | 0,30 | 6,500 % éch. 20/06/2027 | 5 530 | 5 550 | 0,05 | Ovintiv, Inc. | \$ 2 888 | 2 988 | 0,03 |
| 2,545 % éch. 08/11/2032 | 10 000 | 8 347 | 0,08 | Mississippi Power Co. | | | | Pacific Gas & Electric Co. | | | |
| 2,580 % éch. 22/04/2032 | 16 700 | 14 133 | 0,13 | 3,950 % éch. 30/03/2028 | 100 | 97 | 0,00 | 2,500 % éch. 01/02/2031 | 500 | 413 | 0,00 |
| 2,739 % éch. 15/10/2030 | 35 800 | 31 856 | 0,30 | 4,250 % éch. 15/03/2042 | 2 600 | 2 222 | 0,02 | 2,950 % éch. 01/03/2026 | 6 700 | 6 350 | 0,06 |
| 3,540 % éch. 01/05/2028 | 3 100 | 2 960 | 0,03 | Monongahela Power Co. | | | | 3,000 % éch. 01/06/2028 | 16 330 | 14 895 | 0,14 |
| 3,702 % éch. 06/05/2030 | 9 300 | 8 758 | 0,08 | 5,400 % éch. 15/12/2043 | 150 | 147 | 0,00 | 3,150 % éch. 01/01/2026 | 8 009 | 7 685 | 0,07 |
| 3,782 % éch. 01/02/2028 | 3 569 | 3 449 | 0,03 | Morgan Stanley | | | | 3,300 % éch. 15/03/2027 | 11 935 | 11 168 | 0,10 |
| 4,005 % éch. 23/04/2029 | 6 100 | 5 874 | 0,05 | 0,000 % éch. 02/04/2032 (j) | 46 900 | 28 508 | 0,27 | 3,300 % éch. 01/12/2027 | 15 869 | 14 825 | 0,14 |
| 4,457 % éch. 13/11/2031 | € 2 000 | 2 331 | 0,02 | 5,123 % éch. 01/02/2029 | 1 100 | 1 106 | 0,01 | 3,400 % éch. 15/08/2024 | 9 676 | 9 518 | 0,09 |
| 4,565 % éch. 14/06/2030 | \$ 8 536 | 8 359 | 0,08 | 5,250 % éch. 21/04/2034 | 2 315 | 2 316 | 0,02 | 3,450 % éch. 01/07/2025 | 5 877 | 5 691 | 0,05 |
| 5,350 % éch. 01/06/2034 | 14 700 | 14 918 | 0,14 | 5,424 % éch. 21/07/2034 | 11 300 | 11 474 | 0,11 | 3,500 % éch. 15/06/2025 | 13 400 | 12 992 | 0,12 |
| 6,070 % éch. 22/10/2027 | 16 950 | 17 443 | 0,16 | 5,449 % éch. 20/07/2029 | 4 900 | 4 996 | 0,05 | 3,750 % éch. 15/08/2042 | 3 300 | 2 445 | 0,02 |
| 6,087 % éch. 23/10/2029 | 10 000 | 10 519 | 0,10 | 6,407 % éch. 01/11/2029 | 14 000 | 14 847 | 0,14 | 4,000 % éch. 01/12/2046 | 100 | 73 | 0,00 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | | | | Morgan Stanley Bank N.A. | | | | 4,200 % éch. 01/06/2041 | 2 173 | 1 743 | 0,02 |
| 5,110 % éch. 08/12/2026 | 14 650 | 14 787 | 0,14 | 5,882 % éch. 30/10/2026 | 21 000 | 21 602 | 0,20 | 4,300 % éch. 15/03/2045 | 500 | 393 | 0,00 |
| Kenvue, Inc. | | | | MSCI, Inc. | | | | 4,450 % éch. 15/04/2042 | 8 543 | 6 914 | 0,06 |
| 4,900 % éch. 22/03/2033 | 1 100 | 1 134 | 0,01 | 3,250 % éch. 15/08/2033 | 700 | 586 | 0,01 | 4,500 % éch. 15/12/2041 | 3 400 | 2 671 | 0,02 |
| 5,000 % éch. 22/03/2030 | 400 | 413 | 0,00 | 3,625 % éch. 01/09/2030 | 2 400 | 2 174 | 0,02 | 4,750 % éch. 15/02/2044 | 1 889 | 1 581 | 0,01 |
| 5,100 % éch. 22/03/2043 | 6 700 | 6 957 | 0,06 | 3,875 % éch. 15/02/2031 | 100 | 91 | 0,00 | 6,700 % éch. 01/04/2053 | 7 000 | 7 615 | 0,07 |
| Kilroy Realty LP | | | | 4,000 % éch. 15/11/2029 | 5 350 | 5 035 | 0,05 | 6,950 % éch. 15/03/2034 | 5 200 | 5 719 | 0,05 |
| 2,500 % éch. 15/11/2032 | 1 100 | 834 | 0,01 | Nasdaq, Inc. | | | | Pacific Life Global Funding | | | |
| 4,250 % éch. 15/08/2029 | 1 000 | 918 | 0,01 | 5,350 % éch. 28/06/2028 | 400 | 412 | 0,00 | 1,200 % éch. 24/06/2025 | 8 000 | 7 590 | 0,07 |
| Kinder Morgan, Inc. | | | | National Fuel Gas Co. | | | | PacifiCorp | | | |
| 7,420 % éch. 15/02/2037 | 3 388 | 3 676 | 0,03 | 2,950 % éch. 01/03/2031 | 3 700 | 3 103 | 0,03 | 5,350 % éch. 01/12/2053 | 16 855 | 16 238 | 0,15 |
| 8,050 % éch. 15/10/2030 | 36 | 42 | 0,00 | National Health Investors, Inc. | | | | 5,500 % éch. 15/05/2054 | 5 000 | 4 917 | 0,05 |
| Kinetik Holdings LP | | | | 3,000 % éch. 01/02/2031 | 1 800 | 1 441 | 0,01 | 6,250 % éch. 15/10/2037 | 3 600 | 3 848 | 0,04 |
| 6,625 % éch. 15/12/2028 | 700 | 714 | 0,01 | Nationwide Financial Services, Inc. | | | | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC | | | |
| KKR Financial Holdings LLC | | | | 3,900 % éch. 30/11/2049 | 8 700 | 6 911 | 0,06 | 4,375 % éch. 15/10/2028 | 1 700 | 1 591 | 0,01 |
| 5,400 % éch. 23/05/2033 | 10 400 | 10 053 | 0,09 | Nationwide Mutual Insurance Co. | | | | PECO Energy Co. | | | |
| KKR Group Finance Co. LLC | | | | 9,375 % éch. 15/08/2039 | 200 | 265 | 0,00 | 3,000 % éch. 15/09/2049 | 200 | 143 | 0,00 |
| 3,625 % éch. 25/02/2050 | 1 146 | 824 | 0,01 | Netflix, Inc. | | | | Pennsylvania Electric Co. | | | |
| Kraft Heinz Foods Co. | | | | 3,625 % éch. 15/06/2030 | € 29 473 | 33 201 | 0,31 | 3,600 % éch. 01/06/2029 | 6 770 | 6 287 | 0,06 |
| 4,125 % éch. 01/07/2027 | £ 6 150 | 7 759 | 0,07 | 3,875 % éch. 15/11/2029 | 17 481 | 20 009 | 0,19 | 4,150 % éch. 15/04/2025 | 2 205 | 2 163 | 0,02 |
| 4,375 % éch. 01/06/2046 | \$ 24 570 | 21 470 | 0,20 | Neuberger Berman Group LLC | | | | 6,150 % éch. 01/10/2038 | 4 415 | 4 596 | 0,04 |
| Las Vegas Sands Corp. | | | | 4,500 % éch. 15/03/2027 | \$ 12 077 | 11 586 | 0,11 | PennyMac Financial Services Inc. | | | |
| 3,200 % éch. 08/08/2024 | 51 200 | 50 238 | 0,47 | Newfold Digital Holdings Group, Inc. | | | | 7,875 % éch. 15/12/2029 | 100 | 103 | 0,00 |
| 3,500 % éch. 18/08/2026 | 5 556 | 5 300 | 0,05 | 11,750 % éch. 15/10/2028 | 1 500 | 1 615 | 0,02 | Penske Truck Leasing Co. LP | | | |
| 3,900 % éch. 08/08/2029 | 3 300 | 3 045 | 0,03 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | | | | 3,350 % éch. 01/11/2029 | 16 854 | 15 106 | 0,14 |
| Lazard Group LLC | | | | 1,900 % éch. 15/06/2028 | 2 500 | 2 220 | 0,02 | Philip Morris International, Inc. | | | |
| 4,375 % éch. 11/03/2029 | 4 868 | 4 716 | 0,04 | 4,800 % éch. 01/12/2077 | 140 | 121 | 0,00 | 5,625 % éch. 17/11/2029 | 6 700 | 7 030 | 0,07 |
| Lehman Brothers Holdings, Inc. | | | | 5,250 % éch. 28/02/2053 | 4 229 | 4 162 | 0,04 | Physicians Realty LP | | | |
| 0,000 % éch. 23/12/2010 ^ | 900 | 2 | 0,00 | 5,650 % éch. 01/05/2079 | 500 | 472 | 0,00 | 3,950 % éch. 15/01/2028 | 11 672 | 11 131 | 0,10 |
| 5,259 % éch. 12/06/2013 ^ | € 2 807 | 16 | 0,00 | NGPL PipeCo LLC | | | | 4,300 % éch. 15/03/2027 | 7 400 | 7 205 | 0,07 |
| 6,875 % éch. 02/05/2018 ^ | \$ 3 000 | 6 | 0,00 | 4,875 % éch. 15/08/2027 | 8 755 | 8 604 | 0,08 | Piedmont Natural Gas Co., Inc. | | | |
| Leidos, Inc. | | | | Nissan Motor Acceptance Co. LLC | | | | 5,400 % éch. 15/06/2033 | 5 000 | 5 145 | 0,05 |
| 2,300 % éch. 15/02/2031 | 1 885 | 1 579 | 0,01 | 1,850 % éch. 16/09/2026 | 15 000 | 13 496 | 0,13 | Pioneer Natural Resources Co. | | | |
| Liberty Mutual Group, Inc. | | | | 6,282 % éch. 08/03/2024 | 1 000 | 1 000 | 0,01 | 7,200 % éch. 15/01/2028 | 2 394 | 2 574 | 0,02 |
| 3,625 % éch. 23/05/2059 | € 2 800 | 3 028 | 0,03 | NVR, Inc. | | | | Plains All American Pipeline LP | | | |
| 4,569 % éch. 01/02/2029 | \$ 800 | 783 | 0,01 | 3,000 % éch. 15/05/2030 | 21 622 | 19 275 | 0,18 | 4,500 % éch. 15/12/2026 | 1 000 | 988 | 0,01 |
| Marriott International, Inc. | | | | Oaktree Specialty Lending Corp. | | | | 6,700 % éch. 15/05/2036 | 300 | 316 | 0,00 |
| 3,500 % éch. 15/10/2032 | 10 981 | 9 796 | 0,09 | 3,500 % éch. 25/02/2025 | 2 000 | 1 940 | 0,02 | Principal Life Global Funding | | | |
| 5,550 % éch. 15/10/2028 | 2 000 | 2 064 | 0,02 | Occidental Petroleum Corp. | | | | 3,000 % éch. 18/04/2026 | 5 600 | 5 337 | 0,05 |
| Marvell Technology, Inc. | | | | 6,200 % éch. 15/03/2040 | 3 622 | 3 744 | 0,04 | Progress Energy, Inc. | | | |
| 2,450 % éch. 15/04/2028 | 14 850 | 13 410 | 0,13 | 6,600 % éch. 15/03/2046 | 2 000 | 2 168 | 0,02 | 7,750 % éch. 01/03/2031 | 397 | 458 | 0,00 |
| MassMutual Global Funding | | | | 6,625 % éch. 01/09/2030 | 1 000 | 1 065 | 0,01 | Prologis Euro Finance LLC | | | |
| 3,400 % éch. 08/03/2026 | 3 700 | 3 606 | 0,03 | 8,875 % éch. 15/07/2030 | 12 950 | 15 169 | 0,14 | 3,875 % éch. 31/01/2030 | € 2 100 | 2 366 | 0,02 |
| Merck & Co., Inc. | | | | Oklahoma Gas & Electric Co. | | | | 4,250 % éch. 31/01/2043 | 5 000 | 5 584 | 0,05 |
| 5,150 % éch. 17/05/2063 | 2 100 | 2 192 | 0,02 | 5,400 % éch. 15/01/2033 | 3 269 | 3 402 | 0,03 | Protective Life Corp. | | | |
| Meta Platforms, Inc. | | | | Omega Healthcare Investors, Inc. | | | | 3,400 % éch. 15/01/2030 | \$ 21 076 | 18 665 | 0,17 |
| 5,600 % éch. 15/05/2053 | 12 671 | 13 743 | 0,13 | 5,250 % éch. 15/01/2026 | 4 100 | 4 079 | 0,04 | Protective Life Global Funding | | | |
| MetLife Capital Trust | | | | | | | | 5,467 % éch. 08/12/2028 | 1 800 | 1 851 | 0,02 |
| 7,875 % éch. 15/12/2067 | 2 995 | 3 224 | 0,03 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Provident Funding Associates LP | | | | Southern Power Co. | | | | 3,450 % éch. 07/01/2030 | \$ 1 636 | \$ 1 462 | 0,01 |
| 6,375 % éch. 15/06/2025 | \$ 4 100 | \$ 3 783 | 0,04 | 5,250 % éch. 15/07/2043 | \$ 2 800 | \$ 2 654 | 0,02 | 3,500 % éch. 01/09/2031 | 14 956 | 13 653 | 0,13 |
| Realty Income Corp. | | | | Southwest Airlines Co. | | | | 3,700 % éch. 01/09/2031 | 4 975 | 4 360 | 0,04 |
| 2,200 % éch. 15/06/2028 | 5 000 | 4 484 | 0,04 | 5,125 % éch. 15/06/2027 | 7 412 | 7 450 | 0,07 | 4,000 % éch. 11/10/2027 | 1 680 | 1 606 | 0,02 |
| 4,875 % éch. 01/06/2026 | 3 471 | 3 476 | 0,03 | Spirit AeroSystems, Inc. | | | | 4,150 % éch. 11/10/2025 | 1 595 | 1 587 | 0,01 |
| 4,875 % éch. 06/07/2030 | € 500 | 586 | 0,01 | 3,850 % éch. 15/06/2026 | 1 200 | 1 155 | 0,01 | 4,150 % éch. 25/02/2033 | 9 530 | 8 807 | 0,08 |
| Regency Centers LP | | | | 9,375 % éch. 30/11/2029 | 4 000 | 4 382 | 0,04 | 4,300 % éch. 15/02/2027 | 1 604 | 1 556 | 0,01 |
| 2,950 % éch. 15/09/2029 | \$ 1 200 | 1 077 | 0,01 | 9,750 % éch. 15/11/2030 | 12 990 | 13 980 | 0,13 | 4,550 % éch. 25/02/2033 | 946 | 841 | 0,01 |
| Reliance Standard Life Global Funding | | | | Spirit Airlines Pass-Through Trust | | | | 5,800 % éch. 15/07/2037 | 6 500 | 6 617 | 0,06 |
| 2,750 % éch. 21/01/2027 | 6 000 | 5 520 | 0,05 | 4,100 % éch. 01/10/2029 | 2 326 | 2 139 | 0,02 | 5,875 % éch. 15/04/2029 | 5 488 | 5 563 | 0,05 |
| Retail Opportunity Investments Partnership LP | | | | Spirit Realty LP | | | | UnitedHealth Group, Inc. | | | |
| 6,750 % éch. 15/10/2028 | 4 800 | 5 048 | 0,05 | 3,200 % éch. 15/01/2027 | 4 800 | 4 545 | 0,04 | 3,875 % éch. 15/08/2059 | 200 | 163 | 0,00 |
| RGA Global Funding | | | | 3,200 % éch. 15/02/2031 | 2 245 | 1 983 | 0,02 | 5,875 % éch. 15/02/2053 | 22 500 | 25 504 | 0,24 |
| 6,000 % éch. 21/11/2028 | 9 000 | 9 344 | 0,09 | 4,000 % éch. 15/07/2029 | 853 | 810 | 0,01 | 6,050 % éch. 15/02/2063 | 9 579 | 11 063 | 0,10 |
| Rio Oil Finance Trust | | | | 4,450 % éch. 15/09/2026 | 6 100 | 5 986 | 0,06 | Venture Global Calcasieu Pass LLC | | | |
| 8,200 % éch. 06/04/2028 | 3 413 | 3 497 | 0,03 | Sprint Spectrum Co. LLC | | | | 3,875 % éch. 01/11/2033 | 7 800 | 6 619 | 0,06 |
| 9,750 % éch. 06/01/2027 | 139 | 144 | 0,00 | 4,738 % éch. 20/09/2029 | 906 | 899 | 0,01 | 4,125 % éch. 15/08/2031 | 400 | 353 | 0,00 |
| Rockies Express Pipeline LLC | | | | 5,152 % éch. 20/09/2029 | 3 400 | 3 386 | 0,03 | 6,250 % éch. 15/01/2030 | 39 200 | 39 040 | 0,36 |
| 4,800 % éch. 15/05/2030 | 6 500 | 5 956 | 0,06 | Standard Industries, Inc. | | | | Venture Global LNG, Inc. | | | |
| RTX Corp. | | | | 2,250 % éch. 21/11/2026 | € 14 299 | 14 985 | 0,14 | 8,125 % éch. 01/06/2028 | 14 700 | 14 859 | 0,14 |
| 6,100 % éch. 15/03/2034 | 2 700 | 2 931 | 0,03 | STORE Capital Corp. | | | | 8,375 % éch. 01/06/2031 | 14 600 | 14 614 | 0,14 |
| 6,400 % éch. 15/03/2054 | 2 400 | 2 780 | 0,03 | 2,750 % éch. 18/11/2030 | \$ 2 000 | 1 565 | 0,01 | Verizon Communications, Inc. | | | |
| S&P Global, Inc. | | | | 4,500 % éch. 15/03/2028 | 800 | 736 | 0,01 | 2,100 % éch. 22/03/2028 | 1 000 | 905 | 0,01 |
| 4,250 % éch. 01/05/2029 | 13 394 | 13 350 | 0,12 | Stryker Corp. | | | | 2,355 % éch. 15/03/2032 | 736 | 612 | 0,01 |
| 4,750 % éch. 01/08/2028 | 2 600 | 2 646 | 0,02 | 1,950 % éch. 15/06/2030 | 9 550 | 8 170 | 0,08 | 6,218 % éch. 20/03/2026 | 782 | 783 | 0,01 |
| Sabine Pass Liquefaction LLC | | | | Sun Communities Operating LP | | | | VICI Properties LP | | | |
| 4,200 % éch. 15/03/2028 | 5 700 | 5 586 | 0,05 | 4,200 % éch. 15/04/2032 | 3 400 | 3 105 | 0,03 | 3,875 % éch. 15/02/2029 | 9 075 | 8 344 | 0,08 |
| 5,000 % éch. 15/03/2027 | 7 300 | 7 335 | 0,07 | Synchrony Bank | | | | 4,250 % éch. 01/12/2026 | 5 200 | 5 008 | 0,05 |
| 5,625 % éch. 15/05/2024 | 423 | 423 | 0,00 | 5,625 % éch. 23/08/2027 | 7 550 | 7 427 | 0,07 | 4,500 % éch. 15/01/2028 | 6 483 | 6 189 | 0,06 |
| Sabra Health Care LP | | | | Synchrony Financial | | | | 4,625 % éch. 01/12/2029 | 2 825 | 2 665 | 0,02 |
| 3,200 % éch. 01/12/2031 | 4 050 | 3 317 | 0,03 | 3,950 % éch. 01/12/2027 | 5 066 | 4 743 | 0,04 | 5,750 % éch. 01/02/2027 | 2 000 | 2 007 | 0,02 |
| Sammons Financial Group, Inc. | | | | System Energy Resources, Inc. | | | | Virginia Electric and Power Co. | | | |
| 4,450 % éch. 12/05/2027 | 700 | 659 | 0,01 | 2,140 % éch. 09/12/2025 | 16 809 | 15 656 | 0,15 | 5,000 % éch. 01/04/2033 | 4 830 | 4 889 | 0,05 |
| San Diego Gas & Electric Co. | | | | T-Mobile USA, Inc. | | | | Vistra Operations Co. LLC | | | |
| 3,750 % éch. 01/06/2047 | 100 | 80 | 0,00 | 2,050 % éch. 15/02/2028 | 13 940 | 12 585 | 0,12 | 3,550 % éch. 15/07/2024 | 9 500 | 9 369 | 0,09 |
| 4,100 % éch. 15/06/2049 | 3 400 | 2 809 | 0,03 | 2,250 % éch. 15/11/2031 | 16 100 | 13 413 | 0,13 | 3,700 % éch. 30/01/2027 | 7 817 | 7 410 | 0,07 |
| 5,350 % éch. 01/04/2053 | 2 683 | 2 720 | 0,03 | 2,550 % éch. 15/02/2031 | 6 963 | 6 001 | 0,06 | VMware LLC | | | |
| Santander Holdings USA, Inc. | | | | 3,300 % éch. 15/02/2051 | 2 200 | 1 591 | 0,01 | 1,000 % éch. 15/08/2024 | 5 000 | 4 858 | 0,05 |
| 2,490 % éch. 06/01/2028 | 3 895 | 3 569 | 0,03 | 3,875 % éch. 15/04/2030 | 13 200 | 12 521 | 0,12 | 3,900 % éch. 21/08/2027 | 7 900 | 7 669 | 0,07 |
| 3,244 % éch. 05/10/2026 | 2 500 | 2 357 | 0,02 | 4,800 % éch. 15/07/2028 | 8 400 | 8 475 | 0,08 | 4,700 % éch. 15/05/2030 | 19 078 | 18 830 | 0,18 |
| 3,500 % éch. 07/06/2024 | 9 500 | 9 402 | 0,09 | Tapestry, Inc. | | | | Volkswagen Group of America Finance LLC | | | |
| 4,500 % éch. 17/07/2025 | 4 000 | 3 956 | 0,04 | 5,350 % éch. 27/11/2025 | € 7 000 | 7 895 | 0,07 | 6,366 % éch. 07/06/2024 | 1 500 | 1 502 | 0,01 |
| SBA Tower Trust | | | | 7,350 % éch. 27/11/2028 | \$ 2 000 | 2 099 | 0,02 | Vornado Realty LP | | | |
| 1,884 % éch. 15/07/2050 | 25 172 | 23 370 | 0,22 | 7,700 % éch. 27/11/2030 | 1 700 | 1 791 | 0,02 | 2,150 % éch. 01/06/2026 | 700 | 632 | 0,01 |
| 2,836 % éch. 15/01/2050 | 7 009 | 6 771 | 0,06 | Targa Resources Corp. | | | | Walgreens Boots Alliance, Inc. | | | |
| SCE Recovery Funding LLC | | | | 6,125 % éch. 15/03/2033 | 3 361 | 3 541 | 0,03 | 3,450 % éch. 01/06/2026 | 2 000 | 1 902 | 0,02 |
| 5,112 % éch. 14/12/2049 | 3 100 | 3 073 | 0,03 | 6,150 % éch. 01/03/2029 | 4 700 | 4 917 | 0,05 | Warnermedia Holdings, Inc. | | | |
| Sempra | | | | TD SYNEX Corp. | | | | 3,755 % éch. 15/03/2027 | 1 500 | 1 438 | 0,01 |
| 4,125 % éch. 01/04/2052 | 4 100 | 3 539 | 0,03 | 1,750 % éch. 09/08/2026 | 5 950 | 5 398 | 0,05 | 4,279 % éch. 15/03/2032 | 5 732 | 5 248 | 0,05 |
| 5,500 % éch. 01/08/2033 | 6 200 | 6 431 | 0,06 | 2,375 % éch. 09/08/2028 | 9 836 | 8 498 | 0,08 | 5,141 % éch. 15/03/2052 | 9 090 | 7 808 | 0,07 |
| SLM Corp. | | | | Teachers Insurance & Annuity Association of America | | | | WEA Finance LLC | | | |
| 3,125 % éch. 02/11/2026 | 900 | 840 | 0,01 | 4,375 % éch. 15/09/2054 | 18 016 | 17 600 | 0,16 | 3,750 % éch. 17/09/2024 | 7 800 | 7 662 | 0,07 |
| 4,200 % éch. 29/10/2025 | 2 200 | 2 136 | 0,02 | Time Warner Cable Enterprises LLC | | | | WEC Energy Group, Inc. | | | |
| Southern California Edison Co. | | | | 8,375 % éch. 15/07/2033 | 400 | 464 | 0,00 | 4,750 % éch. 09/01/2026 | 7 200 | 7 175 | 0,07 |
| 2,250 % éch. 01/06/2030 | 1 110 | 953 | 0,01 | Times Square Hotel Trust | | | | Wells Fargo & Co. | | | |
| 2,500 % éch. 01/06/2031 | 4 631 | 3 971 | 0,04 | 8,528 % éch. 01/08/2026 | 3 579 | 3 572 | 0,03 | 2,393 % éch. 02/06/2028 | 11 500 | 10 538 | 0,10 |
| 2,750 % éch. 01/02/2032 | 1 900 | 1 636 | 0,02 | Trans-Allegheny Interstate Line Co. | | | | 2,406 % éch. 30/10/2025 | 5 700 | 5 546 | 0,05 |
| 2,950 % éch. 01/02/2051 | 6 400 | 4 351 | 0,04 | 3,850 % éch. 01/06/2025 | 1 157 | 1 134 | 0,01 | 3,196 % éch. 17/06/2027 | 5 800 | 5 547 | 0,05 |
| 3,450 % éch. 01/02/2052 | 5 800 | 4 239 | 0,04 | Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC | | | | 3,584 % éch. 22/05/2028 | 7 000 | 6 672 | 0,06 |
| 3,650 % éch. 01/06/2051 | 3 598 | 2 716 | 0,03 | 3,250 % éch. 15/05/2030 | 5 800 | 5 260 | 0,05 | 4,897 % éch. 25/07/2033 | 14 599 | 14 230 | 0,13 |
| 3,900 % éch. 01/12/2041 | 450 | 367 | 0,00 | TransDigm, Inc. | | | | 5,389 % éch. 24/04/2034 | 1 600 | 1 608 | 0,02 |
| 4,000 % éch. 01/04/2047 | 11 644 | 9 517 | 0,09 | 6,250 % éch. 15/03/2026 | 1 000 | 999 | 0,01 | 5,557 % éch. 25/07/2034 | 80 400 | 81 898 | 0,76 |
| 4,125 % éch. 01/03/2048 | 3 755 | 3 161 | 0,03 | Truist Financial Corp. | | | | 5,574 % éch. 25/07/2029 | 3 300 | 3 371 | 0,03 |
| 5,625 % éch. 01/02/2036 | 2 053 | 2 096 | 0,02 | 4,873 % éch. 26/01/2029 | 4 900 | 4 831 | 0,05 | 6,303 % éch. 23/10/2029 | 13 000 | 13 709 | 0,13 |
| 5,650 % éch. 01/10/2028 | 3 100 | 3 234 | 0,03 | 5,122 % éch. 26/01/2034 | 1 700 | 1 647 | 0,02 | West Virginia United Health System Obligated Group | | | |
| 5,950 % éch. 01/02/2038 | 1 490 | 1 565 | 0,01 | U.S. Airways Pass-Through Trust | | | | 3,129 % éch. 01/06/2050 | 1 500 | 994 | 0,01 |
| 6,650 % éch. 01/04/2029 | 10 800 | 11 523 | 0,11 | 5,900 % éch. 01/04/2026 | 913 | 913 | 0,01 | Western Midstream Operating LP | | | |
| Southern California Gas Co. | | | | U.S. Bancorp | | | | 6,350 % éch. 15/01/2029 | 6 400 | 6 688 | 0,06 |
| 5,200 % éch. 01/06/2033 | 10 000 | 10 291 | 0,10 | 4,653 % éch. 01/02/2029 | 3 500 | 3 447 | 0,03 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp. | | | |
| Southern Co. | | | | 6,787 % éch. 26/10/2027 | 10 200 | 10 654 | 0,10 | 4,150 % éch. 15/03/2024 | 8 860 | 8 824 | 0,08 |
| 1,875 % éch. 15/09/2081 | € 2 800 | 2 660 | 0,02 | UDR, Inc. | | | | 4,700 % éch. 15/09/2028 | 5 471 | 5 414 | 0,05 |
| 5,200 % éch. 15/06/2033 | \$ 1 000 | 1 021 | 0,01 | 3,000 % éch. 15/08/2031 | 7 000 | 6 189 | 0,06 | Weyerhaeuser Co. | | | |
| Southern Co. Gas Capital Corp. | | | | United Airlines Pass-Through Trust | | | | 4,000 % éch. 15/11/2029 | 1 820 | 1 741 | 0,02 |
| 1,750 % éch. 15/01/2031 | 11 390 | 9 324 | 0,09 | 2,700 % éch. 01/11/2033 | 6 406 | 5 433 | 0,05 | 4,750 % éch. 15/05/2026 | 12 100 | 12 049 | 0,11 |
| 3,250 % éch. 15/06/2026 | 1 100 | 1 059 | 0,01 | 2,875 % éch. 07/04/2030 | 481 | 431 | 0,00 | 6,875 % éch. 15/12/2033 | 649 | 715 | 0,01 |
| 4,400 % éch. 30/05/2047 | 600 | 511 | 0,00 | 3,450 % éch. 01/06/2029 | 637 | 593 | 0,01 | 7,350 % éch. 01/07/2026 | 12 350 | 12 836 | 0,12 |
| 5,875 % éch. 15/03/2041 | 1 567 | 1 600 | 0,01 | Xcel Energy, Inc. | | | | 7,375 % éch. 15/03/2032 | 2 889 | 3 356 | 0,03 |
| | | | | | | | | 4,600 % éch. 01/06/2032 | 17 820 | 17 387 | 0,16 |
| | | | | | | | | 5,450 % éch. 15/08/2033 | 6 000 | 6 191 | 0,06 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-----------------------|----------------------------------|------------------------------|
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | ÎLES VIERGES BRITANNIQUES | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| Obligations du Trésor américain | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 1,375 % éch. 15/11/2040 | \$ 29 | \$ 19 | 0,00 | Champion Path Holdings Ltd. | \$ 9 662 | \$ 9 021 | 0,08 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h) | 11 356 637 | \$ 104 935 | 0,98 |
| 1,875 % éch. 15/02/2041 | 183 662 | 132 143 | 1,23 | 4,500 % éch. 27/01/2026 | 13 700 | 11 777 | 0,11 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (h) | 3 787 451 | 35 034 | 0,33 |
| 2,000 % éch. 15/11/2041 | 14 806 | 10 715 | 0,10 | CLP Power Hong Kong Financing Ltd. | 16 700 | 14 170 | 0,13 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (h) | 59 946 504 | 597 345 | 5,58 |
| 2,250 % éch. 15/05/2041 | 67 320 | 51 312 | 0,48 | 2,125 % éch. 30/06/2030 | 3 800 | 3 905 | 0,04 | PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (h) | 329 257 | 4 477 | 0,04 |
| 2,375 % éch. 15/02/2042 | 38 663 | 29 681 | 0,28 | Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. | 4 900 | 4 175 | 0,04 | | | | |
| 2,750 % éch. 15/11/2047 | 105 800 | 82 392 | 0,77 | JMH Co. Ltd. | | | | | | | |
| 3,125 % éch. 15/08/2044 | 43 | 36 | 0,00 | 2,500 % éch. 09/04/2031 | | | | | | | |
| 3,250 % éch. 15/05/2042 | 139 903 | 122 809 | 1,15 | Total Îles Vierges britanniques | | 43 048 | 0,40 | | | | |
| 3,375 % éch. 15/08/2042 | 2 000 | 1 784 | 0,02 | | | | | | | | |
| 4,375 % éch. 15/08/2043 | 25 400 | 25 936 | 0,24 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| 4,750 % éch. 15/11/2043 | 64 200 | 68 885 | 0,64 | BILLETS DE TRÉSORERIE | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h) | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (f) | | | | AT+T, Inc. | | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h) | | | |
| 0,125 % éch. 15/07/2024 | 3 628 | 3 566 | 0,03 | 5,700 % éch. 19/03/2024 | 32 000 | 31 597 | 0,30 | | | | |
| 0,125 % éch. 15/10/2024 | 35 377 | 34 608 | 0,32 | L3Harris Technologies, Inc. | 5 500 | 5 485 | 0,05 | | | | |
| 0,125 % éch. 15/04/2025 | 6 551 | 6 318 | 0,06 | 5,800 % éch. 16/01/2024 | | 37 082 | 0,35 | | | | |
| 0,250 % éch. 15/01/2025 | 99 894 | 96 970 | 0,91 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | Total des Fonds d'investissement | | | |
| 1,125 % éch. 15/01/2033 | 13 221 | 12 517 | 0,12 | 10,900 % éch. | | | | \$ 1 045 218 | | | |
| 1,500 % éch. 15/02/2053 | 96 979 | 88 019 | 0,82 | 04/01/2024 (d)(e) HUF 7 901 000 | | | | 9,76 | | | |
| 2,375 % éch. 15/01/2025 | 16 486 | 16 358 | 0,15 | Total des Instruments à court terme | | | | | | | |
| STRIPS du Trésor américain | | | | Total des Valeurs mobilières | | | | | | | |
| 0,000 % éch. 15/11/2042 (d) | 9 000 | 3 923 | 0,04 | | | \$ 10 091 319 | 94,18 | | | | |
| 0,000 % éch. 15/05/2043 (d) | 25 | 11 | 0,00 | Total des Valeurs mobilières | | | | | | | |
| | | 788 002 | 7,36 | | | | | | | | |
| ACTIONS | | | | | | | | | | | |
| BONS DE SOUSCRIPTION | | | | | | | | | | | |
| Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060 | 7 228 | 0 | 0,00 | | | | | | | | |
| Total États-Unis | | 6 097 846 | 56,91 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|---------------------|--|--|---------------------|
| CEW | 4,980 % | 11/12/2023 | 03/01/2024 | CAD 200 000 | Province de l'Ontario 3,650 % éch. 02/06/2033 | \$ (151 161) | \$ 151 676 | \$ 152 304 | 1,41 |
| | | | | | Province du Québec 3,250 % éch. 01/09/2032 | (8 415) | | | |
| DEU | 5,150 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 22 200 | Billets du Trésor américain 0,625 % éch. 15/05/2030 | (22 670) | 22 200 | 22 213 | 0,21 |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 3 237 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | (3 302) | 3 237 | 3 238 | 0,03 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (185 548) | \$ 177 113 | \$ 177 755 | 1,65 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 434 | \$ 1 788 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 453 | 2 249 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 3 621 | 15 885 | 0,15 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 15 | 190 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Long | 03/2024 | 2 192 | 1 167 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 71 | (600) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 583 | 1 575 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 325 | (1 153) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 54 | (612) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 695 | 6 036 | 0,06 |
| | | | | \$ 26 525 | 0,25 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 26 525 | 0,25 |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Toll Brothers Finance Corp. | (1,000) % | 20/06/2024 | \$ 23 500 | \$ (101) | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| AES Corp. | 5,000 % | 20/12/2025 | \$ 7 900 | \$ (884) | (0,01) |
| AES Corp. | 5,000 | 20/06/2026 | 2 400 | (244) | 0,00 |
| Airbus SE | 1,000 | 20/12/2028 | € 10 300 | 202 | 0,00 |
| American International Group, Inc. | 1,000 | 20/12/2027 | \$ 8 000 | 198 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2024 | 3 400 | 11 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | 7 600 | (89) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/12/2025 | 2 000 | (9) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 54 000 | (364) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 1 300 | (7) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 29 600 | 459 | 0,00 |
| Atlantia SpA | 1,000 | 20/12/2025 | € 1 800 | 93 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/06/2025 | \$ 7 000 | 168 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2025 | 900 | 26 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 1 000 | 20 | 0,00 |
| BP Capital Markets PLC | 1,000 | 20/12/2025 | € 6 800 | (15) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/06/2028 | 23 600 | 379 | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/12/2028 | 1 600 | 34 | 0,00 |
| Cellnex Telecom S.A. | 5,000 | 20/12/2030 | 7 400 | 164 | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20/12/2024 | \$ 5 000 | (360) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2024 | 32 050 | 200 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2024 | 27 900 | 545 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 18 750 | 87 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 2 000 | 16 | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20/12/2026 | 2 050 | (171) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20/06/2028 | 2 435 | 68 | 0,00 |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20/06/2028 | € 2 700 | 44 | 0,00 |
| Hess Corp. | 1,000 | 20/06/2026 | \$ 7 000 | 158 | 0,00 |
| Lennar Corp. | 5,000 | 20/12/2026 | 3 200 | (254) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 600 | 19 | 0,00 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 11 300 | (116) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/06/2024 | € 25 300 | (125) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2024 | 9 000 | 30 | 0,00 |
| Southwest Airlines Co. | 1,000 | 20/12/2026 | \$ 3 100 | 44 | 0,00 |
| T-Mobile USA, Inc. | 5,000 | 20/06/2028 | 7 800 | 69 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20/06/2028 | € 24 800 | 293 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/12/2024 | 63 700 | 667 | 0,01 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/12/2027 | 1 750 | 40 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/06/2028 | 2 800 | 32 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | \$ 14 400 | 35 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 1 900 | (23) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2027 | 500 | 16 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 9 400 | 144 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 2 300 | 33 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20/06/2024 | € 12 700 | (110) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20/12/2026 | 4 100 | (52) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20/06/2028 | 1 000 | 14 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20/06/2028 | 11 100 | (37) | 0,00 |
| | | | | \$ 1 448 | 0,01 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.IG-39 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2027 | \$ 1 200 | \$ 17 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2028 | 10 000 | 60 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 1 090 200 | 7 812 | 0,07 |
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | € 11 300 | 576 | 0,01 |
| | | | | \$ 8 465 | 0,08 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,175 % | 28/02/2052 | £ 7 200 | \$ (3 824) | (0,03) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 | 20/10/2033 | 3 000 | 335 | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 71 000 | 5 173 | 0,05 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/09/2024 | ¥ 1 829 900 | 15 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,300 | 20/03/2028 | 1 192 900 | 60 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 20/09/2043 | 4 000 000 | 865 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | \$ 4 400 | (61) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 200 | 9 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 4 600 | (90) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 4 600 | (114) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 4 900 | (132) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 9 000 | (253) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 9 200 | (329) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2030 | CAD 244 800 | (11 510) | (0,11) |
| À recevoir | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 0,000 | 21/06/2025 | 17 500 | (25) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 01/06/2032 | 55 400 | (1 820) | (0,02) |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/09/2025 | 111 000 | 1 328 | 0,01 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | 381 100 | 4 356 | 0,04 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,000 | 21/06/2025 | 17 500 | 85 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | AUD 30 700 | 1 025 | 0,01 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | 9 800 | 442 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,000 | 17/03/2053 | € 88 530 | 40 024 | 0,37 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,175 | 17/03/2033 | 214 110 | (47 747) | (0,45) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | 31 200 | (1 034) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | 88 900 | (5 746) | (0,05) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 5 400 | (342) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 62 700 | (3 113) | (0,03) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 28 000 | (1 374) | (0,01) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 7 200 | (107) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 6 700 | (165) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 101 600 | 6 671 | 0,06 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 58 900 | 2 382 | 0,02 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 7 400 | 578 | 0,01 |
| | | | | | \$ (14 438) | (0,13) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (4 626) | (0,04) |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| FAR | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,600 % | 13/12/2024 | 70 300 | \$ 798 | \$ 488 | 0,01 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,975 | 29/05/2024 | 119 800 | 132 | 46 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ 930 | \$ 534 | 0,01 |

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 2 800 | \$ (12) | \$ (11) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 2 800 | (12) | (6) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 4 600 | (21) | (34) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 9 300 | (42) | (117) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 4 600 | (21) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 9 300 | (42) | (2) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 % | 22/01/2024 | 9 300 | \$ (38) | \$ (29) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 9 300 | (38) | (27) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 4 200 | (16) | (13) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 6 400 | (23) | (72) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 4 200 | (16) | (12) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 6 400 | (23) | 0 | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,273 | 16/01/2024 | 5 000 | (21) | (14) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 5 000 | (23) | (36) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 5 000 | (22) | (64) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,723 | 16/01/2024 | 5 000 | (21) | (8) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 5 000 | (23) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 5 000 | (22) | (1) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,195 | 29/05/2024 | 59 900 | (132) | (222) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 8 800 | (36) | (25) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 4 500 | (19) | (18) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 9 000 | (38) | (30) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 9 000 | (46) | (95) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 9 000 | (45) | (115) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 8 700 | (39) | (141) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 8 800 | (36) | (28) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 4 500 | (19) | (9) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 9 000 | (38) | (13) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 9 000 | (46) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 9 000 | (45) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 10 300 | (23) | (36) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 10 300 | (24) | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 4 800 | (21) | (15) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 4 800 | (20) | (13) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 18/01/2024 | 5 000 | (25) | (26) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 5 000 | (23) | (79) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 4 800 | (21) | (25) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 4 800 | (20) | (16) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 18/01/2024 | 5 000 | (25) | (9) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 5 000 | (23) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 6 500 | (26) | (50) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 8 500 | (31) | (134) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 6 500 | (26) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 8 500 | (31) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 9 300 | (45) | (53) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 4 600 | (22) | (30) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 4 900 | (22) | (77) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 9 300 | (44) | (167) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 9 300 | (45) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 4 600 | (22) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 4 900 | (22) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 9 300 | (44) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 6 400 | (27) | (17) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 6 400 | (27) | (12) | 0,00 |
| UAG | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 4 900 | (24) | (25) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 4 900 | (24) | (9) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (1 682) | \$ (1 941) | (0,02) |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | \$ 97,891 | 09/01/2024 | 10 300 | \$ (40) | \$ (117) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 101,094 | 06/02/2024 | 8 200 | (33) | (66) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 99,227 | 06/02/2024 | 5 200 | (28) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 101,227 | 06/02/2024 | 5 200 | (19) | (38) | 0,00 |
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 95,813 | 06/02/2024 | 10 300 | (57) | (46) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 97,813 | 06/02/2024 | 10 300 | (54) | (56) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | 99,906 | 09/01/2024 | 5 100 | (13) | (4) | 0,00 |
| | | | | | \$ (244) | \$ (330) | 0,00 |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 1 100 | \$ (38) | \$ 49 | \$ 11 | 0,00 |
| BRC | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20/12/2025 | 7 800 | 170 | (80) | 90 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2024 | 31 400 | (1 185) | 1 372 | 187 | 0,00 |
| CBK | Intrum AB | 5,000 | 20/12/2024 | € 3 000 | 286 | (311) | (25) | 0,00 |
| DUB | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2025 | \$ 5 700 | (5) | 69 | 64 | 0,00 |
| GST | Equinix, Inc. | 5,000 | 20/06/2027 | 4 500 | 629 | (98) | 531 | 0,01 |
| | Intrum AB | 5,000 | 20/12/2024 | € 15 100 | 1 696 | (1 825) | (129) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2025 | \$ 5 700 | (7) | 71 | 64 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/12/2026 | 1 400 | 33 | (7) | 26 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2024 | 5 700 | (229) | 263 | 34 | 0,00 |

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| JLN | Intrum AB | 5,000 % | 20/12/2024 | € 5 000 | \$ 560 | \$ (602) | \$ (42) | 0,00 |
| JPM | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | \$ 4 400 | (99) | 97 | (2) | 0,00 |
| | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20/06/2024 | 16 300 | 223 | (154) | 69 | 0,00 |
| | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | 8 100 | 112 | (54) | 58 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2025 | 7 600 | (1) | 87 | 86 | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2027 | 15 800 | (978) | 1 066 | 88 | 0,00 |
| | Brookfield Asset Management, Inc. | 1,000 | 20/06/2025 | 7 900 | 0 | 76 | 76 | 0,00 |
| | Consolidated Edison Co. of New York, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | 16 500 | 323 | (175) | 148 | 0,00 |
| | Pioneer Natural Resources Co. | 1,000 | 20/06/2025 | 8 400 | (408) | 513 | 105 | 0,00 |
| MYI | Intrum AB | 5,000 | 20/12/2024 | € 2 700 | 311 | (334) | (23) | 0,00 |
| | | | | | \$ 1 393 | \$ 23 | \$ 1 416 | 0,01 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC | Indice iTraxx Japan 40 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2028 | ¥ 2 637 000 | \$ 284 | \$ 104 | \$ 388 | 0,00 |
| DBL | Indice iTraxx Japan 40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 1 332 000 | 127 | 69 | 196 | 0,00 |
| JPM | Indice iTraxx Japan 40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 11 370 000 | 1 145 | 528 | 1 673 | 0,02 |
| | | | | | \$ 1 556 | \$ 701 | \$ 2 257 | 0,02 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 50 097 | \$ 33 186 | \$ 0 | \$ (1 005) | (0,01) | |
| BOA | 01/2024 | COP | 135 913 333 | 33 790 | 0 | (1 252) | (0,01) | |
| | 01/2024 | £ | 15 319 | 19 433 | 0 | (96) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 35 533 | COP 135 913 333 | 0 | (490) | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 23 954 | ¥ 3 534 930 | 1 135 | 0 | 1 135 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 3 426 | NOK 36 426 | 161 | 0 | 161 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 100 | \$ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | COP | 135 913 333 | 35 020 | 471 | 0 | 471 | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 4 550 | 1 198 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 4 047 | INR 338 665 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD | 34 549 | \$ 22 832 | 0 | (747) | (747) | (0,01) |
| | 01/2024 | CAD | 200 628 | 148 051 | 0 | (4 104) | (4 104) | (0,04) |
| | 01/2024 | DKK | 62 549 | 9 226 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 1 401 843 | 1 542 672 | 0 | (6 229) | (6 229) | (0,06) |
| | 01/2024 | £ | 38 163 | 48 407 | 0 | (245) | (245) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 1 247 443 | 3 546 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 294 300 | 2 006 | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 62 364 | 3 401 | 0 | (265) | (265) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 4 895 | CAD 6 554 | 76 | 0 | 76 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 41 439 | € 37 868 | 451 | (49) | 402 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 859 | £ 1 453 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 | HUF 1 429 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 602 435 | \$ 32 497 | 0 | (402) | (402) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 1 917 | IDR 29 550 353 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 14 064 | INR 1 176 339 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | PLN | 1 426 | \$ 326 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 2 093 | CAD 2 793 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 1 205 | TRY 36 759 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD | 224 | \$ 169 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 9 | THB 306 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 6 122 | TRY 192 235 | 0 | (75) | (75) | 0,00 |
| | 04/2024 | | 6 551 | 211 086 | 0 | (94) | (94) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | CHF | 115 | \$ 132 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | COP | 131 077 730 | 33 311 | 0 | (524) | (524) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 7 248 | 9 112 | 0 | (128) | (128) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 606 318 | 1 731 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 548 922 | 30 871 | 0 | (1 399) | (1 399) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 4 636 | CAD 6 286 | 132 | 0 | 132 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 67 606 | COP 262 691 763 | 533 | (460) | 73 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 787 | € 1 620 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 5 727 | £ 4 522 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 420 | NOK 4 487 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 264 545 | \$ 13 906 | 0 | (543) | (543) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ | 19 892 | BRL 99 477 | 554 | 0 | 554 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| DUB | 01/2024 | COP | 130 876 200 | \$ 34 242 | \$ 459 | \$ 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 32 900 | COP 130 876 200 | 883 | 0 | 0,01 | |
| GLM | 01/2024 | ZAR | 142 | \$ 8 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | AUD | 73 392 | 48 272 | 0 | (1 817) | (0,02) | |
| GLM | 01/2024 | CAD | 279 793 | 205 889 | 0 | (6 325) | (0,06) | |
| | 01/2024 | DKK | 82 866 | 12 224 | 0 | (59) | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | MXN | 180 377 | 10 283 | 0 | (321) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 577 | HUF 210 850 | 31 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | 675 | MXN 11 766 | 17 | 0 | 17 | 0,00 | |
| | 03/2024 | 3 799 | IDR 58 400 847 | 0 | (12) | (12) | 0,00 | |
| GLM | 03/2024 | 1 336 | TRY 41 953 | 0 | (15) | (15) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 5 276 379 | \$ 15 043 | 0 | (204) | 0,00 | |
| JPM | 03/2024 | \$ | 1 863 | IDR 28 761 962 | 2 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | 4 217 | INR 352 581 | 5 | 0 | 5 | 0,00 | |
| JPM | 03/2024 | 289 | SGD 384 | 3 | 0 | 3 | 0,00 | |
| | 06/2024 | KRW | 326 333 | \$ 250 | 0 | (4) | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | AUD | 20 405 | 13 530 | 0 | (396) | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 38 644 | 41 977 | 0 | (721) | (0,01) | |
| MBC | 01/2024 | HUF | 8 280 310 | 22 595 | 0 | (1 268) | (0,01) | |
| | 01/2024 | ¥ | 290 500 | 2 038 | 0 | (24) | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | \$ | 1 794 | AUD 2 649 | 14 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 495 | COP 2 000 000 | 19 | 0 | 19 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | 4 846 | £ 3 836 | 45 | 0 | 45 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 147 042 | \$ 7 694 | 0 | (337) | 0,00 | |
| MYI | 03/2024 | \$ | 2 273 | IDR 35 032 549 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | CAD | 28 617 | \$ 21 700 | 0 | (3) | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | € | 1 289 | 1 429 | 5 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 1 118 | 1 426 | 1 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | HUF | 527 775 | 1 500 | 0 | (25) | 0,00 | |
| | 01/2024 | SEK | 617 | 62 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | SGD | 297 | 225 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 434 | CHF 367 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 924 | € 832 | 0 | (5) | (5) | 0,00 | |
| | 01/2024 | 7 196 | £ 5 635 | 0 | (13) | (13) | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | 9 108 | ¥ 1 342 798 | 423 | 0 | 423 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 49 | SEK 496 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | 81 | SGD 107 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | 3 530 | ZAR 64 841 | 12 | 0 | 12 | 0,00 | |
| MYI | 03/2024 | 19 756 | IDR 303 988 143 | 0 | (43) | (43) | 0,00 | |
| | 06/2024 | KRW | 44 749 | \$ 34 | 0 | 0 | 0,00 | |
| RBC | 04/2024 | MXN | 263 | 15 | 0 | 0 | 0,00 | |
| SCX | 01/2024 | CAD | 7 794 | 5 814 | 0 | (98) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 1 688 | IDR 25 860 271 | 0 | (11) | 0,00 | |
| SCX | 03/2024 | 9 179 | INR 767 612 | 14 | 0 | 14 | 0,00 | |
| | 03/2024 | 20 396 | THB 704 992 | 396 | 0 | 396 | 0,00 | |
| TOR | 01/2024 | 15 054 | ¥ 2 208 244 | 619 | 0 | 619 | 0,01 | |
| UAG | 01/2024 | AUD | 16 495 | \$ 10 944 | 0 | (314) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 207 356 | 262 414 | 0 | (1 933) | (0,02) | |
| UAG | 01/2024 | \$ | 19 400 | NOK 206 943 | 980 | 0 | 980 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR | 334 210 | \$ 17 508 | 0 | (743) | (0,01) | |
| | | | | \$ 7 563 | \$ (33 094) | \$ (25 531) | (0,24) | |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de distribution et Investisseurs en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ | 4 900 | AUD 7 390 | \$ 143 | \$ 0 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 314 | 475 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD | 120 | \$ 82 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 15 | 10 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 7 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 7 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | \$ | 1 937 | AUD 2 922 | 57 | 0 | 57 |
| RYL | 01/2024 | AUD | 3 | \$ 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ | 2 361 | AUD 3 558 | 68 | 0 | 68 |
| | | | | \$ 278 | \$ (1) | \$ 277 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, Investisseurs en CHF (couverte) de capitalisation, Administrations en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation et W en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF | 1 086 | \$ 1 265 | \$ 0 | \$ (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 9 324 | CHF 7 952 | 129 | 0 | 129 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | CHF 889 | \$ 1 022 | \$ 0 | \$ (34) | \$ (34) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 36 566 | CHF 31 858 | 1 305 | 0 | 1 305 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | CHF 2 125 | \$ 2 455 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 205 294 | CHF 178 856 | 7 323 | 0 | 7 323 | 0,07 |
| GLM | 01/2024 | CHF 477 | \$ 545 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 229 994 | CHF 201 538 | 9 587 | 0 | 9 587 | 0,10 |
| MYI | 01/2024 | | 200 109 | 8 641 | 0 | 8 641 | 0,08 |
| SCX | 01/2024 | CHF 453 | \$ 541 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 369 | CHF 5 539 | 216 | 0 | 216 | 0,00 |
| | | | | \$ 27 204 | \$ (153) | \$ 27 051 | 0,26 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CZK (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| GLM | 01/2024 | \$ 2 863 | CZK 63 389 | \$ 0 | \$ (27) | \$ (27) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | | 65 740 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | CZK 1 720 | \$ 77 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 2 773 | CZK 61 872 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | \$ 0 | \$ (33) | \$ (33) | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de distribution, E en EUR (exposition au risque de change) de distribution et H Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 938 | AUD 1 417 | \$ 29 | \$ 0 | \$ 29 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 497 | 752 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | 814 | £ 642 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 557 | ¥ 82 267 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 01/2024 | 101 | NZD 165 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 63 | SEK 658 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 597 | \$ 652 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 7 350 | € 6 744 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 543 | £ 1 216 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | 905 | ¥ 133 148 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € 136 | 150 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 336 | CAD 453 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | 832 | € 771 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 01/2024 | 347 | £ 274 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 5 925 | CAD 8 052 | 182 | 0 | 182 | 0,00 |
| | 01/2024 | 845 | CHF 741 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 114 | \$ 124 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 689 | AUD 1 040 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 01/2024 | 547 | CAD 740 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 01/2024 | 62 577 | € 56 920 | 314 | 0 | 314 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 346 | CAD 456 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 305 | £ 239 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 263 | 209 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 8 362 | 6 607 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| | | | | \$ 894 | \$ (12) | \$ 882 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de distribution, T en EUR (couverte) de capitalisation, W en EUR (couverte) de capitalisation et W en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 11 546 | \$ 12 674 | \$ 1 | \$ (84) | \$ (83) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 822 087 | € 747 897 | 4 269 | (2) | 4 267 | 0,04 |
| BRC | 01/2024 | 705 134 | 641 159 | 3 285 | 0 | 3 285 | 0,03 |
| CBK | 01/2024 | € 712 | \$ 769 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 461 | € 3 170 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 4 633 | \$ 5 072 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 615 266 | € 562 732 | 6 499 | 0 | 6 499 | 0,06 |
| | | | | \$ 14 096 | \$ (149) | \$ 13 947 | 0,13 |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de distribution, Administrations en GBP (couverte) de distribution, E en GBP (couverte) de distribution, R en GBP (couverte) de distribution, W en GBP (couverte) capitalisation et W en GBP de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devises à livrer | Devises à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 14 563 | \$ 18 431 | \$ 0 | \$ (134) | \$ (134) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 21 326 | £ 16 791 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 243 | \$ 307 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 354 502 | £ 280 582 | 3 196 | 0 | 3 196 | 0,03 |
| BRC | 01/2024 | 1 327 | 1 049 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 6 815 | \$ 8 648 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 330 | £ 1 840 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | £ 50 541 | \$ 63 659 | 0 | (774) | (774) | (0,01) |
| GLM | 01/2024 | 22 | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 6 141 | 7 818 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 433 | £ 1 126 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 4 645 | 3 680 | 49 | (2) | 47 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 365 122 | 288 662 | 2 876 | 0 | 2 876 | 0,03 |
| SSB | 01/2024 | £ 13 863 | \$ 17 445 | 0 | (228) | (228) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 1 161 | 1 453 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 365 046 | £ 288 446 | 2 677 | 0 | 2 677 | 0,02 |
| | | | | \$ 8 906 | \$ (1 219) | \$ 7 687 | 0,07 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devises à livrer | Devises à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 7 002 | NOK 74 447 | \$ 330 | \$ 0 | \$ 330 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 7 842 | 83 922 | 423 | 0 | 423 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | NOK 20 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 11 334 | NOK 120 770 | 559 | 0 | 559 | 0,01 |
| | | | | \$ 1 312 | \$ 0 | \$ 1 312 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devises à livrer | Devises à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 79 893 | SEK 833 307 | \$ 2 814 | \$ 0 | \$ 2 814 | 0,03 |
| BRC | 01/2024 | SEK 221 | \$ 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 1 228 | 118 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 11 874 | SEK 123 909 | 424 | 0 | 424 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SEK 560 | \$ 54 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 30 | SEK 315 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 46 | 468 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | SEK 314 | \$ 30 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 88 201 | SEK 916 038 | 2 717 | 0 | 2 717 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | SEK 111 | \$ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 89 144 | SEK 920 034 | 2 170 | 0 | 2 170 | 0,02 |
| | | | | \$ 8 127 | \$ (7) | \$ 8 120 | 0,08 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, Administrations en SGD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et W en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devises à livrer | Devises à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| DUB | 01/2024 | \$ 45 202 | SGD 60 087 | \$ 363 | \$ 0 | \$ 363 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SGD 370 | \$ 277 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 035 | SGD 1 385 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | 11 095 | 14 800 | 128 | 0 | 128 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD 554 | \$ 416 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 324 | SGD 433 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 113 | \$ 85 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 193 | SGD 253 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 42 159 | 56 237 | 486 | 0 | 486 | 0,01 |
| | 02/2024 | SGD 1 448 | \$ 1 098 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | \$ 38 997 | SGD 52 032 | 459 | 0 | 459 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 292 | \$ 221 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | \$ 1 456 | \$ (11) | \$ 1 445 | 0,01 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 37 093 0,35

Total des Investissements

\$ 11 372 642 106,15

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (658 920) (6,15)

Actifs nets

\$ 10 713 722 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
 (b) Titre à rémunération en nature.
 (c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
 (d) Titre à coupon zéro.
 (e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
 (f) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
 (g) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
 (h) Affilié au Fonds.
 (i) Titre convertible conditionnel.
 (j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,70 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|-------------------------|------------|--------------|---------------------|
| Citigroup, Inc. | 2,572 % | 03/06/2031 | 26/05/2020 - 09/07/2020 | \$ 24 742 | \$ 20 889 | 0,20 |
| Morgan Stanley | 0,000 | 02/04/2032 | 11/02/2020 | 41 265 | 28 508 | 0,27 |
| Oracle Corp. | 4,100 | 25/03/2061 | 24/03/2021 - 26/03/2021 | 6 834 | 5 040 | 0,05 |
| Oracle Corp. | 6,150 | 09/11/2029 | 13/07/2023 | 10 486 | 10 765 | 0,10 |
| Oracle Corp. | 6,250 | 09/11/2032 | 07/11/2022 - 12/07/2023 | 25 064 | 26 663 | 0,25 |
| | | | | \$ 108 391 | \$ 91 865 | 0,87 |

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 8 265 \$ (31 décembre 2022 : 4 048 \$) et un montant en numéraire de 3 891 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 260 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 177 696 \$ (31 décembre 2022 : 213 307 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 8 110 \$ (31 décembre 2022 : 55 028 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|----------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 10 078 308 | \$ 13 011 | \$ 10 091 319 |
| Fonds d'investissement | 787 238 | 257 980 | 0 | 1 045 218 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 177 113 | 0 | 177 113 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 26 715 | 32 277 | 0 | 58 992 |
| Totaux | \$ 813 953 | \$ 10 545 678 | \$ 13 011 | \$ 11 372 642 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|----------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 1 | \$ 9 770 167 | \$ 8 376 | \$ 9 778 544 |
| Fonds d'investissement | 782 040 | 256 286 | 0 | 1 038 326 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 75 423 | 0 | 75 423 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (44 604) | (36 888) | 0 | (81 492) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (136 255) | 0 | (136 255) |
| Totaux | \$ 737 437 | \$ 9 928 733 | \$ 8 376 | \$ 10 674 546 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 3,200 % | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (2 248) | \$ (2 504) | (0,03) |
| | 4,050 | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | \$ (1 399) | (1 414) | (0,01) |
| | 4,300 | 22/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (335) | (337) | 0,00 |
| | 4,500 | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (199) | (202) | 0,00 |
| BRC | 2,500 | 04/12/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (2 080) | (2 084) | (0,02) |
| JML | 2,000 | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (1 162) | (1 287) | (0,01) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (7 828) | (0,07) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (833) | \$ 940 | \$ 107 | \$ 32 | \$ 0 | \$ 32 |
| BOA | 2 872 | (3 410) | (538) | 5 200 | (5 790) | (590) |
| BOM | S/O | S/O | S/O | 360 | (470) | (110) |
| BPS | (4 216) | 6 880 | 2 664 | (21 024) | 20 550 | (474) |
| BRC | 5 041 | (8 780) | (3 739) | 977 | 0 | 977 |
| BSH | S/O | S/O | S/O | (11) | 0 | (11) |
| CBK | 6 148 | (8 080) | (1 932) | 36 530 | (37 360) | (830) |
| CLY | S/O | S/O | S/O | 24 | 0 | 24 |
| DBL | 196 | 0 | 196 | S/O | S/O | S/O |
| DUB | 995 | (770) | 225 | (3 383) | 3 210 | (173) |
| FAR | 365 | (390) | (25) | S/O | S/O | S/O |
| FBF | S/O | S/O | S/O | 189 | (250) | (61) |
| GLM | 616 | (190) | 426 | (8 272) | 8 408 | 136 |
| GST | 490 | (470) | 20 | 1 037 | (1 030) | 7 |
| JLN | (42) | 0 | (42) | (237) | 0 | (237) |
| JPM | 1 401 | (1 300) | 101 | (9 156) | 8 080 | (1 076) |
| MBC | 4 179 | (7 500) | (3 321) | 20 345 | (19 090) | 1 255 |
| MYC | 60 | 0 | 60 | (594) | 630 | 36 |
| MYI | 9 504 | (11 110) | (1 606) | (342) | 280 | (62) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | 236 | (350) | (114) |
| RYL | S/O | S/O | S/O | 14 | 0 | 14 |
| SAL | (106) | 0 | (106) | (90) | 0 | (90) |
| SCX | 6 112 | (7 970) | (1 858) | (14 373) | 13 840 | (533) |
| SOG | S/O | S/O | S/O | (88) | 30 | (58) |
| SSB | (225) | 290 | 65 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 1 077 | (1 020) | 57 | 365 | (2 890) | (2 525) |
| UAG | 3 459 | (4 341) | (882) | 623 | 0 | 623 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 64,03 | 63,86 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 30,03 | 28,59 |
| Autres valeurs mobilières | 0,12 | 0,33 |
| Fonds d'investissement | 9,76 | 9,85 |
| Contrats de mise en pension | 1,65 | 0,72 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,25 | (0,41) |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,04) | (0,44) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,35 | 0,08 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (1,29) |
| Contrats de prise en pension | (0,07) | (0,04) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Australie | 2,35 | 1,72 |
| Autriche | 0,05 | 0,21 |
| Belgique | 0,14 | 0,12 |
| Bermudes | 0,52 | 0,66 |
| Bésil | 0,19 | 0,32 |
| Canada | 2,63 | 2,14 |
| Îles Caïmans | 3,08 | 3,29 |
| Chili | 0,02 | 0,06 |
| Chine | 0,17 | 0,27 |
| Colombie | 0,08 | S/O |
| Chypre | S/O | 0,09 |
| République tchèque | 0,15 | S/O |
| Danemark | 0,38 | 0,30 |
| Finlande | 0,27 | 0,20 |
| France | 3,23 | 2,51 |
| Allemagne | 1,55 | 1,98 |
| Guernesey, Îles Anglo-normandes | 0,36 | 0,33 |
| Hong Kong | 0,12 | 0,27 |
| Inde | 0,21 | 0,25 |
| Indonésie | 0,16 | 0,17 |
| Irlande | 0,58 | 0,78 |
| Israël | 0,09 | S/O |
| Italie | 1,53 | 2,62 |
| Japon | 1,84 | 1,59 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,51 | 0,53 |
| Libéria | 0,03 | S/O |
| Luxembourg | 0,90 | 2,33 |
| Île Maurice | 0,09 | 0,37 |
| Mexique | 0,61 | 0,18 |
| Multinationales | 0,03 | 0,03 |
| Pays-Bas | 2,94 | 2,56 |
| Norvège | 0,26 | 0,13 |
| Panama | S/O | 0,18 |
| Pérou | 0,02 | 1,25 |
| Pologne | 0,10 | S/O |
| Portugal | 0,14 | S/O |
| Qatar | 0,10 | 0,10 |
| Roumanie | 0,37 | 0,31 |
| Russie | 0,00 | 0,02 |
| Arabie saoudite | 0,93 | 0,16 |
| Singapour | 0,38 | 0,17 |
| Slovaquie | 0,00 | 0,00 |
| Slovénie | 0,11 | 0,10 |
| Afrique du Sud | 0,77 | 0,95 |
| Corée du Sud | 0,20 | 0,07 |
| Espagne | 0,33 | 0,25 |
| Supranationales | 0,23 | 0,22 |
| Suède | 0,16 | 0,32 |
| Suisse | 1,23 | 2,23 |
| Thaïlande | 0,07 | 0,07 |
| Turquie | 0,03 | 0,04 |
| Ukraine | S/O | 0,02 |
| Émirats arabes unis | 0,07 | 0,08 |
| Royaume-Uni | 6,00 | 5,72 |
| États-Unis | 56,91 | 51,20 |
| Îles Vierges britanniques | 0,40 | 0,40 |
| Instruments à court terme | 0,56 | 2,91 |
| Fonds d'investissement | 9,76 | 9,85 |
| Contrats de mise en pension | 1,65 | 0,72 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,25 | (0,41) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | (0,07) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,08 | 0,01 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,13) | (0,38) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,01 | 0,45 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (0,81) |
| Options sur titres | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | 0,03 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,02 | 0,05 |
| Contrats de change à terme | (0,24) | (0,50) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,57 | 0,86 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (1,29) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (6,15) | (1,29) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Cie de Financement Foncier S.A. 3,125 % éch. 17/05/2029 | € 4 200 | \$ 4 715 | 0,22 | 0,250 % éch. 16/07/2035 | € 1 000 | \$ 834 | 0,04 | HONG KONG | | | |
| EMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | | EMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| CNP Assurances SACA 1,250 % éch. 27/01/2029 | 2 200 | 2 150 | 0,10 | Total France | | 53 481 | 2,46 | Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 2,375 % éch. 02/02/2051 | \$ 300 | \$ 204 | 0,01 |
| 4,875 % éch. 07/10/2030 (e)(f) | \$ 800 | 630 | 0,03 | | | 143 520 | 6,61 | 3,750 % éch. 07/06/2032 | € 3 500 | 4 046 | 0,18 |
| Credit Agricole Assurances S.A. 1,500 % éch. 06/10/2031 | € 3 400 | 3 076 | 0,14 | ALLEMAGNE | | | | 5,250 % éch. 11/01/2053 | \$ 3 200 | 3 612 | 0,17 |
| Crédit Agricole S.A. 0,125 % éch. 09/12/2027 | 700 | 687 | 0,03 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Total Hong Kong | | 7 862 | 0,36 |
| 0,375 % éch. 21/10/2025 | 400 | 421 | 0,02 | Amprion GmbH 3,875 % éch. 07/09/2028 | 2 600 | 2 965 | 0,14 | INDE | | | |
| 4,375 % éch. 27/11/2033 | 2 400 | 2 789 | 0,13 | Commerzbank AG 3,125 % éch. 13/06/2033 | 2 400 | 2 724 | 0,13 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 5,301 % éch. 12/07/2028 | \$ 1 700 | 1 740 | 0,08 | 5,250 % éch. 25/03/2029 | 3 700 | 4 297 | 0,20 | Bharti Airtel Ltd. 4,375 % éch. 10/06/2025 | 1 200 | 1 184 | 0,05 |
| Électricité de France S.A. 4,625 % éch. 25/01/2043 | € 1 500 | 1 748 | 0,08 | Deutsche Bahn Finance GmbH 4,000 % éch. 23/11/2043 | 300 | 362 | 0,02 | JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % éch. 18/05/2031 | 3 462 | 3 020 | 0,14 |
| 5,500 % éch. 25/01/2035 | £ 300 | 387 | 0,02 | Deutsche Boerse AG 1,447 % éch. 01/04/2025 (g) | \$ 2 000 | 1 976 | 0,09 | ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027 | 1 765 | 1 689 | 0,08 |
| Engie S.A. 3,625 % éch. 11/01/2030 | € 1 000 | 1 136 | 0,05 | 1,875 % éch. 23/02/2028 | \$ 2 500 | 2 598 | 0,12 | ReNew Wind Energy AP2 4,500 % éch. 14/07/2028 | 3 000 | 2 669 | 0,12 |
| 4,000 % éch. 11/01/2035 | 2 000 | 2 302 | 0,11 | 2,129 % éch. 24/11/2026 (g) | \$ 400 | 375 | 0,02 | Total Inde | | 8 562 | 0,39 |
| 4,250 % éch. 11/01/2043 | 1 200 | 1 393 | 0,06 | 2,311 % éch. 16/11/2027 | 3 000 | 2 745 | 0,13 | INDONÉSIE | | | |
| Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement 0,125 % éch. 16/09/2025 | 3 500 | 3 637 | 0,17 | 2,552 % éch. 07/01/2028 | 1 600 | 1 470 | 0,07 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Kering S.A. 5,125 % éch. 23/11/2026 | £ 900 | 1 171 | 0,05 | 3,125 % éch. 19/05/2033 | € 1 300 | 1 474 | 0,07 | Bank Mandiri Persero Tbk PT 2,000 % éch. 19/04/2026 | 800 | 743 | 0,03 |
| New Immo Holding S.A. 2,750 % éch. 26/11/2026 | € 900 | 914 | 0,04 | 3,547 % éch. 18/09/2031 | \$ 450 | 395 | 0,02 | IRLANDE | | | |
| SEB S.A. 1,500 % éch. 31/05/2024 | 200 | 218 | 0,01 | 3,742 % éch. 07/01/2033 | 1 300 | 1 068 | 0,05 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Société Générale S.A. 0,500 % éch. 12/06/2029 | 400 | 384 | 0,02 | Deutsche Boerse AG 3,875 % éch. 28/09/2026 | € 1 500 | 1 694 | 0,08 | Cumulus Static CLO DAC 5,499 % éch. 25/04/2033 | € 1 400 | 1 546 | 0,07 |
| 2,625 % éch. 22/01/2025 | \$ 200 | 194 | 0,01 | 3,875 % éch. 28/09/2033 | 3 000 | 3 532 | 0,16 | OCP Euro CLO DAC 5,873 % éch. 20/01/2033 | 2 000 | 2 209 | 0,10 |
| 3,625 % éch. 01/03/2041 | 1 050 | 717 | 0,03 | E.ON SE 3,875 % éch. 12/01/2035 | 1 000 | 1 152 | 0,05 | Total IRLANDE | | 3 755 | 0,17 |
| 4,000 % éch. 12/01/2027 | 2 200 | 2 105 | 0,10 | Eurogrid GmbH 3,279 % éch. 05/09/2031 | 1 000 | 1 101 | 0,05 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 6,691 % éch. 10/01/2034 | 3 100 | 3 277 | 0,15 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % éch. 09/07/2027 | 400 | 430 | 0,02 | AIB Group PLC 2,250 % éch. 04/04/2028 | 2 800 | 2 969 | 0,14 |
| 7,367 % éch. 10/01/2053 | 2 500 | 2 639 | 0,12 | IHO Verwaltungen GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature) 3,750 % éch. 15/09/2026 (b) | 300 | 328 | 0,01 | 4,625 % éch. 23/07/2029 | 2 700 | 3 081 | 0,14 |
| 10,000 % éch. 14/11/2028 (e)(f) | 500 | 536 | 0,02 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % éch. 15/09/2028 (c) | 7 450 | 7 363 | 0,34 | 5,250 % éch. 23/10/2031 | 1 900 | 2 271 | 0,11 |
| Société Générale SFH S.A. 3,625 % éch. 31/07/2026 | € 2 800 | 3 157 | 0,14 | 0,750 % éch. 30/09/2030 | \$ 1 100 | 894 | 0,04 | 5,750 % éch. 16/02/2029 | 2 000 | 2 378 | 0,11 |
| Suez SACA 5,000 % éch. 03/11/2032 | 1 200 | 1 469 | 0,07 | 1,375 % éch. 07/06/2032 | € 1 300 | 1 316 | 0,06 | Bank of Ireland Group PLC 4,875 % éch. 16/07/2028 | 1 500 | 1 735 | 0,08 |
| Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % éch. 26/03/2028 | 1 200 | 1 123 | 0,05 | 2,750 % éch. 14/02/2033 | 750 | 843 | 0,04 | 6,253 % éch. 16/09/2026 | \$ 250 | 253 | 0,01 |
| | | 90 039 | 4,15 | 4,875 % éch. 03/02/2031 | £ 2 400 | 3 281 | 0,15 | 7,594 % éch. 06/12/2032 | € 3 000 | 3 991 | 0,18 |
| | | | | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 1,000 % éch. 26/05/2042 | € 1 700 | 1 486 | 0,07 | CCEP Finance Ireland DAC 0,500 % éch. 06/09/2029 | € 1 900 | 1 821 | 0,08 |
| | | | | Robert Bosch GmbH 4,375 % éch. 02/06/2043 | 1 000 | 1 188 | 0,05 | Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % éch. 15/01/2026 | 300 | 327 | 0,02 |
| | | | | Vonovia SE 0,000 % éch. 01/12/2025 (c) | 200 | 206 | 0,01 | Total IRLANDE | | 18 826 | 0,87 |
| | | | | 0,250 % éch. 01/09/2028 | 1 900 | 1 787 | 0,08 | | | 22 581 | 1,04 |
| | | | | 1,625 % éch. 01/09/2051 | 100 | 64 | 0,00 | ITALIE | | | |
| | | | | ZF Finance GmbH 2,250 % éch. 03/05/2028 | 1 800 | 1 830 | 0,08 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| | | | | | | 50 944 | 2,35 | Koromo Italy SRL 4,676 % éch. 26/02/2035 | 1 764 | 1 954 | 0,09 |
| | | | | EMISSIONS SOUVERAINES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | Land Berlin 2,750 % éch. 14/02/2033 | 2 600 | 2 915 | 0,14 | Intesa Sanpaolo SpA 2,625 % éch. 11/03/2036 | £ 1 000 | 932 | 0,04 |
| | | | | État de Hesse 2,875 % éch. 04/07/2033 | 1 200 | 1 361 | 0,06 | 3,625 % éch. 30/06/2028 | € 1 400 | 1 586 | 0,07 |
| | | | | État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie 0,500 % éch. 25/11/2039 | 200 | 154 | 0,01 | 3,875 % éch. 12/01/2028 | \$ 1 400 | 1 300 | 0,06 |
| | | | | 2,900 % éch. 07/06/2033 | 1 975 | 2 238 | 0,10 | 4,000 % éch. 23/09/2029 | 1 300 | 1 184 | 0,05 |
| | | | | Total Allemagne | | 6 668 | 0,31 | 4,198 % éch. 01/06/2032 | 900 | 743 | 0,03 |
| | | | | GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | 4,950 % éch. 01/06/2042 | 2 100 | 1 497 | 0,07 |
| | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,017 % éch. 26/06/2024 | 4 600 | 4 554 | 0,21 |
| | | | | Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % éch. 29/07/2026 | 1 850 | 1 687 | 0,08 | 6,625 % éch. 31/05/2033 | € 900 | 1 214 | 0,06 |
| | | | | Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % éch. 22/06/2026 | 1 100 | 1 099 | 0,05 | 6,625 % éch. 20/06/2033 | \$ 800 | 820 | 0,04 |
| | | | | 1,750 % éch. 24/11/2028 | 2 300 | 2 116 | 0,10 | 7,778 % éch. 20/06/2054 | 400 | 413 | 0,02 |
| | | | | Total Guernesey, Îles Anglo-normandes | | 4 902 | 0,23 | 9,125 % éch. 07/09/2029 (e)(f) | € 1 500 | 1 827 | 0,08 |
| | | | | | | | | Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | 2 900 | 2 951 | 0,14 |
| | | | | | | | | Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029 | 1 800 | 1 760 | 0,08 |
| | | | | | | | | Telecom Italia SpA 7,875 % éch. 31/07/2028 | 1 650 | 2 030 | 0,09 |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| UniCredit SpA | | | | CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV- | | | | 3,649 % éch. 06/04/2028 | \$ 3 400 | \$ 3 243 | 0,15 |
| 1,982 % éch. 03/06/2027 | \$ 1 900 | \$ 1 739 | 0,08 | SIF Pan European Core Fund | | | | 4,875 % éch. 29/06/2029 | | | |
| 3,500 % éch. 31/07/2030 | € 2 500 | 2 827 | 0,13 | 0,500 % éch. 27/01/2028 | € 600 | \$ 587 | 0,03 | (e)(f) | € 2 800 | 2 801 | 0,13 |
| 4,625 % éch. 12/04/2027 | \$ 1 000 | 978 | 0,05 | 0,900 % éch. 12/10/2029 | 3 700 | 3 405 | 0,16 | 5,250 % éch. 14/09/2027 | £ 1 200 | 1 549 | 0,07 |
| 5,459 % éch. 30/06/2035 | 1 500 | 1 413 | 0,07 | CPI Property Group S.A. | | | | CTP NV | | | |
| 7,296 % éch. 02/04/2034 | 3 400 | 3 500 | 0,16 | 1,625 % éch. 23/04/2027 | 700 | 570 | 0,03 | 0,500 % éch. 21/06/2025 | € 3 800 | 3 958 | 0,18 |
| | | | | 1,750 % éch. 14/01/2030 | 1 550 | 979 | 0,04 | 0,875 % éch. 20/01/2026 | 2 900 | 2 973 | 0,14 |
| | | 33 268 | 1,53 | 2,750 % éch. 12/05/2026 | 1 062 | 982 | 0,05 | 1,250 % éch. 21/06/2029 | 500 | 459 | 0,02 |
| Total Italie | | 35 222 | 1,62 | 2,750 % éch. 22/01/2028 | £ 500 | 449 | 0,02 | 1,500 % éch. 27/09/2031 | 2 500 | 2 157 | 0,10 |
| | | | | Logicor Financng SARL | | | | Danfoss Finance BV | | | |
| JAPON | | | | 1,625 % éch. 17/01/2030 | € 500 | 474 | 0,02 | 0,125 % éch. 28/04/2026 | 1 500 | 1 540 | 0,07 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,000 % éch. 17/01/2034 (h) | 2 900 | 2 514 | 0,12 | Digital Dutch Finco BV | | | |
| East Japan Railway Co. | | | | Segro Capital SARL | | | | 1,000 % éch. 15/01/2032 | 350 | 309 | 0,01 |
| 3,976 % éch. 05/09/2032 | € 750 | 883 | 0,04 | 1,875 % éch. 23/03/2030 | 950 | 966 | 0,04 | 1,250 % éch. 01/02/2031 | 1 900 | 1 760 | 0,08 |
| 4,389 % éch. 05/09/2043 | 3 100 | 3 729 | 0,17 | SELP Finance SARL | | | | Digital Intrepid Holding BV | | | |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | | | 0,875 % éch. 27/05/2029 | 1 950 | 1 837 | 0,08 | 0,625 % éch. 15/07/2031 | 1 600 | 1 390 | 0,06 |
| 0,337 % éch. 08/06/2027 | 900 | 925 | 0,04 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 1,375 % éch. 18/07/2032 | 1 000 | 902 | 0,04 |
| 0,962 % éch. 11/10/2025 | \$ 400 | 386 | 0,02 | État du Grand-Duché de Luxembourg | | | | EDP Finance BV | | | |
| 1,538 % éch. 20/07/2027 | 1 650 | 1 508 | 0,07 | 0,000 % éch. 14/09/2032 (c) | 2 000 | 1 795 | 0,08 | 6,300 % éch. 11/10/2027 | \$ 4 100 | 4 304 | 0,20 |
| 1,640 % éch. 13/10/2027 | 300 | 273 | 0,01 | Total Luxembourg | | 18 533 | 0,85 | EnBW International Finance BV | | | |
| 2,048 % éch. 17/07/2030 | 700 | 589 | 0,03 | ÎLE MAURICE | | | | 4,300 % éch. 23/05/2034 | € 1 700 | 1 989 | 0,09 |
| 2,341 % éch. 19/01/2028 | 450 | 417 | 0,02 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Enel Finance International NV | | | |
| 2,494 % éch. 13/10/2032 | 2 900 | 2 434 | 0,11 | India Green Energy Holdings | | | | 0,375 % éch. 28/05/2029 | 1 500 | 1 429 | 0,07 |
| 2,757 % éch. 13/09/2026 | 3 932 | 3 715 | 0,17 | 5,375 % éch. 29/04/2024 | \$ 3 550 | 3 515 | 0,16 | 1,875 % éch. 12/07/2028 | \$ 1 700 | 1 486 | 0,07 |
| 3,273 % éch. 19/09/2025 | € 2 000 | 2 196 | 0,10 | India Green Power Holdings | | | | 2,250 % éch. 12/07/2031 | 4 600 | 3 741 | 0,17 |
| 3,837 % éch. 17/04/2026 | \$ 1 400 | 1 374 | 0,06 | 4,000 % éch. 22/02/2027 | 1 200 | 1 102 | 0,05 | 2,650 % éch. 10/09/2024 | 200 | 195 | 0,01 |
| 5,475 % éch. 22/02/2031 | 200 | 205 | 0,01 | Total Île Maurice | | 4 617 | 0,21 | 2,875 % éch. 11/04/2029 | £ 3 100 | 3 628 | 0,17 |
| Mizuho Financial Group, Inc. | | | | MEXIQUE | | | | 7,750 % éch. 14/10/2052 | \$ 2 000 | 2 465 | 0,11 |
| 0,184 % éch. 13/04/2026 | € 600 | 619 | 0,03 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Holcim Sterling Finance Netherlands BV | | | |
| 2,201 % éch. 10/07/2031 | \$ 2 900 | 2 416 | 0,11 | Banco Mercantil del Norte S.A. | | | | 2,250 % éch. 04/04/2034 | £ 1 800 | 1 777 | 0,08 |
| 2,839 % éch. 13/09/2026 | 8 261 | 7 838 | 0,36 | 6,625 % éch. 24/01/2032 (e)(f) | 3 300 | 2 812 | 0,13 | Iberdrola International BV | | | |
| 3,170 % éch. 11/09/2027 | 10 226 | 9 612 | 0,44 | Metalsa S.A. de C.V. | | | | 6,750 % éch. 15/09/2033 | \$ 1 200 | 1 280 | 0,06 |
| 3,261 % éch. 22/05/2030 | 4 800 | 4 380 | 0,20 | 3,750 % éch. 04/05/2031 | 3 900 | 3 213 | 0,15 | ING Groep NV | | | |
| Nippon Life Insurance Co. | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 1,250 % éch. 16/02/2027 | € 1 200 | 1 261 | 0,06 |
| 2,900 % éch. 16/09/2051 | 700 | 577 | 0,03 | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | | 1,400 % éch. 01/07/2026 | £ 1 800 | 1 695 | 0,08 |
| Nomura Holdings, Inc. | | | | 6,338 % éch. 04/05/2053 | 2 000 | 2 041 | 0,09 | 2,125 % éch. 23/05/2026 | € 2 700 | 2 919 | 0,14 |
| 2,172 % éch. 14/07/2028 | 4 100 | 3 605 | 0,17 | Total Mexique | | 8 066 | 0,37 | 3,875 % éch. 16/05/2027 | | | |
| 2,329 % éch. 22/01/2027 | 3 900 | 3 578 | 0,17 | MULTINATIONALES | | | | (e)(f) | \$ 100 | 81 | 0,00 |
| Norinchukin Bank | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,125 % éch. 24/08/2033 | € 2 100 | 2 332 | 0,11 |
| 1,284 % éch. 22/09/2026 | 2 000 | 1 807 | 0,08 | NXP BV | | | | 4,250 % éch. 16/05/2031 | | | |
| 2,080 % éch. 22/09/2031 | 800 | 656 | 0,03 | 2,500 % éch. 11/05/2031 | 2 660 | 2 261 | 0,10 | (e)(f) | \$ 500 | 365 | 0,02 |
| NTT Finance Corp. | | | | 3,875 % éch. 18/06/2026 | 150 | 146 | 0,01 | 4,252 % éch. 28/03/2033 | 2 200 | 2 064 | 0,10 |
| 4,142 % éch. 26/07/2024 | 2 900 | 2 882 | 0,13 | 5,000 % éch. 15/01/2033 | 4 500 | 4 510 | 0,21 | 6,500 % éch. 16/04/2025 | | | |
| 4,239 % éch. 25/07/2025 | 300 | 297 | 0,01 | Total Multinationales | | 6 917 | 0,32 | (e)(f) | 300 | 293 | 0,01 |
| 4,372 % éch. 27/07/2027 | 800 | 793 | 0,04 | PAYS-BAS | | | | JAB Holdings BV | | | |
| ORIX Corp. | | | | TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS | | | | 4,500 % éch. 08/04/2052 | 4 800 | 3 756 | 0,17 |
| 1,919 % éch. 20/04/2026 | € 3 000 | 3 220 | 0,15 | Bumper NL BV | | | | 5,000 % éch. 12/06/2033 | € 200 | 239 | 0,01 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | | 4,529 % éch. 22/03/2035 | € 2 400 | 2 655 | 0,12 | JDE Peet's NV | | | |
| 2,130 % éch. 08/07/2030 | \$ 2 300 | 1 939 | 0,09 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 1,125 % éch. 16/06/2033 | 300 | 267 | 0,01 |
| 2,348 % éch. 15/01/2025 | 3 000 | 2 914 | 0,13 | ABN AMRO Bank NV | | | | 2,250 % éch. 24/09/2031 | \$ 2 050 | 1 643 | 0,08 |
| 2,472 % éch. 14/01/2029 | 4 800 | 4 275 | 0,20 | 2,470 % éch. 13/12/2029 | \$ 6 800 | 5 988 | 0,28 | 4,125 % éch. 23/01/2030 | € 800 | 910 | 0,04 |
| 3,010 % éch. 19/10/2026 | 1 395 | 1 329 | 0,06 | 4,000 % éch. 16/01/2028 | € 400 | 454 | 0,02 | LeasePlan Corp. NV | | | |
| 3,202 % éch. 17/09/2029 (f) | 400 | 364 | 0,02 | 4,750 % éch. 28/07/2025 | € 1 500 | 1 471 | 0,07 | 0,250 % éch. 07/09/2026 | 3 500 | 3 556 | 0,16 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | | 5,250 % éch. 26/05/2026 | £ 2 000 | 2 571 | 0,12 | Lseg Netherlands BV | | | |
| 1,350 % éch. 16/09/2026 | 2 500 | 2 276 | 0,11 | Achmea Bank NV | | | | 4,125 % éch. 29/09/2026 | 1 500 | 1 701 | 0,08 |
| 2,800 % éch. 10/03/2027 | 1 200 | 1 126 | 0,05 | 3,000 % éch. 31/01/2030 | € 2 100 | 2 351 | 0,11 | 4,231 % éch. 29/09/2030 | 2 300 | 2 686 | 0,12 |
| 3,629 % éch. 06/04/2026 | € 3 500 | 3 900 | 0,18 | Arcadis NV | | | | Mondelez International Holdings Netherlands BV | | | |
| | | 79 037 | 3,64 | 4,875 % éch. 28/02/2028 | 1 900 | 2 177 | 0,10 | 0,250 % éch. 09/09/2029 | 2 000 | 1 907 | 0,09 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ASR Nederland NV | | | | Nationale-Nederlanden Bank NV | | | |
| Development Bank of Japan, Inc. | | | | 3,625 % éch. 12/12/2028 | 2 500 | 2 801 | 0,13 | 0,500 % éch. 21/09/2028 | 3 200 | 3 124 | 0,14 |
| 5,125 % éch. 01/09/2026 | \$ 1 800 | 1 835 | 0,09 | Compass Group Finance Netherlands BV | | | | 1,875 % éch. 17/05/2032 | 500 | 514 | 0,02 |
| Japan Finance Organization for Municipalities | | | | 3,000 % éch. 08/03/2030 | 1 700 | 1 875 | 0,09 | 3,250 % éch. 28/05/2027 | 2 000 | 2 245 | 0,10 |
| 3,375 % éch. 22/02/2028 | € 2 100 | 2 376 | 0,11 | Cooperatieve Rabobank UA | | | | NE Property BV | | | |
| | | 4 211 | 0,20 | 1,004 % éch. 24/09/2026 | \$ 3 500 | 3 252 | 0,15 | 2,000 % éch. 20/01/2030 | 4 200 | 3 734 | 0,17 |
| Total Japon | | 83 248 | 3,84 | 1,106 % éch. 24/02/2027 | 800 | 733 | 0,03 | 3,375 % éch. 14/07/2027 | 600 | 627 | 0,03 |
| JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | NN NV | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Aptiv PLC | | | | 4,500 % éch. 15/01/2026 (e) | 200 | 221 | 0,01 |
| Aptiv PLC | | | | 3,100 % éch. 01/12/2051 | \$ 1 800 | 1 175 | 0,05 | 4,625 % éch. 13/01/2048 | 200 | 222 | 0,01 |
| 3,100 % éch. 01/12/2051 | \$ 1 800 | 1 175 | 0,05 | LUXEMBOURG | | | | OCI NV | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,700 % éch. 16/03/2033 | \$ 2 000 | 2 044 | 0,09 |
| Acef Holding S.C.A. | | | | Acef Holding S.C.A. | | | | Prosus NV | | | |
| 0,750 % éch. 14/06/2028 | € 1 700 | 1 619 | 0,07 | 0,750 % éch. 14/06/2028 | € 1 700 | 1 619 | 0,07 | 2,085 % éch. 19/01/2030 | € 1 300 | 1 204 | 0,06 |
| 1,250 % éch. 26/04/2030 | 2 650 | 2 356 | 0,11 | 1,250 % éch. 26/04/2030 | 2 650 | 2 356 | 0,11 | 2,778 % éch. 19/01/2034 | 200 | 173 | 0,01 |
| | | | | | | | | 3,257 % éch. 19/01/2027 | \$ 2 200 | 2 033 | 0,09 |
| | | | | | | | | Sandoz Finance BV | | | |
| | | | | | | | | 4,220 % éch. 17/04/2030 | € 2 900 | 3 329 | 0,15 |
| | | | | | | | | Sartorius Finance BV | | | |
| | | | | | | | | 4,250 % éch. 14/09/2026 | 600 | 678 | 0,03 |
| | | | | | | | | 4,375 % éch. 14/09/2029 | 500 | 573 | 0,03 |
| | | | | | | | | Siemens Energy Finance BV | | | |
| | | | | | | | | 4,000 % éch. 05/04/2026 | 2 500 | 2 732 | 0,13 |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------|------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | |
| Union européenne | | | | Union européenne | | | | Union européenne | | | | | |
| 4,000 % éch. 04/04/2044 | 3 900 | 4 886 | 0,23 | Chanel Ceres PLC | € 800 | 824 | 0,04 | 5,125 % éch. 12/05/2027 | € 400 | 459 | 0,02 | | |
| Total Supranationales | | 81 345 | 3,75 | 1,000 % éch. 31/07/2031 | 2 801 | 2 610 | 0,12 | (e)(f) | \$ 3 800 | 3 936 | 0,18 | | |
| SUÈDE | | | | SUÈDE | | | | SUÈDE | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | |
| EQT AB | | | | EQT AB | | | | EQT AB | | | | | |
| 0,875 % éch. 14/05/2031 | 3 200 | 2 821 | 0,13 | Clarion Funding PLC | € 700 | 674 | 0,03 | NatWest Markets PLC | 5,899 % éch. 23/08/2028 | AUD 900 | 629 | 0,03 | |
| 2,375 % éch. 06/04/2028 | 1 000 | 1 045 | 0,05 | 1,875 % éch. 22/01/2035 | 200 | 190 | 0,01 | Peabody Capital PLC | 2,750 % éch. 02/03/2034 | € 500 | 529 | 0,02 | |
| 2,875 % éch. 06/04/2032 | 3 000 | 2 964 | 0,14 | CSL Finance PLC | \$ 1 100 | 1 073 | 0,05 | Pearson Funding PLC | 3,750 % éch. 04/06/2030 | 500 | 595 | 0,03 | |
| Sagax AB | | | | Derwent London PLC | € 2 700 | 2 744 | 0,13 | Pinnacle Bidco PLC | 8,250 % éch. 11/10/2028 | € 2 000 | 2 303 | 0,11 | |
| 1,125 % éch. 30/01/2027 | 800 | 796 | 0,04 | Direct Line Insurance Group PLC | 4,000 % éch. 05/06/2032 | 300 | 312 | 0,01 | Places for People Treasury PLC | 2,500 % éch. 26/01/2036 | € 2 200 | 2 119 | 0,10 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB | | | | DS Smith PLC | € 1 300 | 1 479 | 0,07 | 6,250 % éch. 06/12/2041 | 2 300 | 3 161 | 0,15 | | |
| 4,000 % éch. 09/11/2026 | 1 500 | 1 687 | 0,08 | 4,375 % éch. 27/07/2027 | € 1 300 | 1 479 | 0,07 | Prudential Funding Asia PLC | 2,950 % éch. 03/11/2033 | \$ 600 | 528 | 0,02 | |
| Svenska Handelsbanken AB | | | | ENW Finance PLC | € 1 700 | 2 229 | 0,10 | Reckitt Benckiser Treasury Services PLC | 1,750 % éch. 19/05/2032 | € 100 | 107 | 0,00 | |
| 0,125 % éch. 03/11/2026 | 300 | 305 | 0,01 | 4,893 % éch. 24/11/2032 | € 1 700 | 2 229 | 0,10 | Santander UK Group Holdings PLC | 1,673 % éch. 14/06/2027 | \$ 800 | 728 | 0,03 | |
| | | 9 618 | 0,45 | Ferguson Finance PLC | \$ 900 | 806 | 0,04 | 3,823 % éch. 03/11/2028 | 2 300 | 2 163 | 0,10 | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | |
| Kommuninvest Sverige AB | | | | Kommuninvest Sverige AB | | | | Kommuninvest Sverige AB | | | | | |
| 3,375 % éch. 15/03/2027 | 700 | 796 | 0,04 | 4,650 % éch. 20/04/2032 | 2 850 | 2 756 | 0,13 | 6,833 % éch. 21/11/2026 | 1 500 | 1 529 | 0,07 | | |
| Obligation internationale du gouvernement suédois | | | | Grainger PLC | € 1 260 | 1 378 | 0,06 | Severn Trent Utilities Finance PLC | 2,000 % éch. 02/06/2040 | € 300 | 255 | 0,01 | |
| 0,125 % éch. 09/09/2030 | SEK 9 000 | 793 | 0,03 | HSBC Holdings PLC | 1,750 % éch. 24/07/2027 | 3 100 | 3 633 | 0,17 | 2,625 % éch. 22/02/2033 | 1 900 | 2 039 | 0,09 | |
| | | 1 589 | 0,07 | 2,013 % éch. 22/09/2028 | \$ 1 500 | 1 336 | 0,06 | 5,250 % éch. 04/04/2036 | 1 900 | 2 508 | 0,12 | | |
| Total Suède | | 11 207 | 0,52 | 2,804 % éch. 24/05/2032 | 1 200 | 1 002 | 0,05 | SSE PLC | 2,875 % éch. 01/08/2029 | € 300 | 328 | 0,02 | |
| SUISSE | | | | SUISSE | | | | SUISSE | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | |
| UBS AG | | | | UBS AG | | | | UBS AG | | | | | |
| 1,375 % éch. 13/01/2025 | \$ 200 | 192 | 0,01 | 3,000 % éch. 22/07/2028 | € 100 | 119 | 0,01 | 4,000 % éch. 05/09/2031 | 3 700 | 4 280 | 0,20 | | |
| 5,650 % éch. 11/09/2028 | 3 300 | 3 425 | 0,16 | 3,973 % éch. 22/05/2030 | \$ 4 300 | 4 020 | 0,19 | Standard Chartered PLC | 0,800 % éch. 17/11/2029 | 1 100 | 1 059 | 0,05 | |
| 5,800 % éch. 11/09/2025 | 4 000 | 4 048 | 0,19 | 4,041 % éch. 13/03/2028 | 2 790 | 2 690 | 0,12 | 1,214 % éch. 23/03/2025 | \$ 800 | 795 | 0,04 | | |
| UBS Group AG | | | | 4,300 % éch. 08/03/2026 | 5 987 | 5 889 | 0,27 | 1,456 % éch. 14/01/2027 | 3 018 | 2 767 | 0,13 | | |
| 2,593 % éch. 11/09/2025 | 800 | 783 | 0,04 | 5,402 % éch. 11/08/2033 | 600 | 603 | 0,03 | 2,678 % éch. 29/06/2032 | 500 | 407 | 0,02 | | |
| 4,125 % éch. 24/09/2025 | 4 300 | 4 209 | 0,19 | 6,332 % éch. 09/03/2044 | 250 | 270 | 0,01 | 4,874 % éch. 10/05/2031 | € 2 500 | 2 897 | 0,13 | | |
| 4,125 % éch. 15/04/2026 | 3 602 | 3 519 | 0,16 | 7,336 % éch. 03/11/2026 | 600 | 623 | 0,03 | 6,301 % éch. 09/01/2029 | \$ 500 | 514 | 0,02 | | |
| 4,194 % éch. 01/04/2031 | 10 350 | 9 646 | 0,44 | Informa PLC | € 3 000 | 3 224 | 0,15 | 7,767 % éch. 16/11/2028 | 900 | 973 | 0,04 | | |
| 4,282 % éch. 09/01/2028 | 1 050 | 1 018 | 0,05 | InterContinental Hotels Group PLC | € 4 400 | 5 235 | 0,24 | Tesco Corporate Treasury Services PLC | 1,875 % éch. 02/11/2028 | € 2 600 | 2 926 | 0,13 | |
| 4,375 % éch. 10/02/2031 | 1 600 | 1 267 | 0,06 | 3,375 % éch. 08/10/2028 | € 4 400 | 5 235 | 0,24 | 2,750 % éch. 27/04/2030 | 500 | 564 | 0,03 | | |
| (e)(f) | 800 | 828 | 0,04 | John Lewis PLC | 4,250 % éch. 18/12/2034 | 300 | 278 | 0,01 | Tesco Property Finance PLC | 5,744 % éch. 13/04/2040 | 189 | 244 | 0,01 |
| 9,599 % éch. 12/01/2034 | 1 300 | 1 406 | 0,06 | 6,125 % éch. 21/01/2025 | 200 | 254 | 0,01 | Thames Water Utilities Finance PLC | 0,875 % éch. 31/01/2028 | € 3 000 | 2 835 | 0,13 | |
| 9,250 % éch. 13/11/2028 | 900 | 1 000 | 0,04 | Land Securities Capital Markets PLC | 4,875 % éch. 15/09/2034 | 5 000 | 6 555 | 0,30 | 1,250 % éch. 31/01/2032 | 100 | 83 | 0,00 | |
| (e)(f) | | | | Legal & General Group PLC | 5,625 % éch. 24/03/2031 | 500 | 543 | 0,03 | 4,375 % éch. 18/01/2031 | 100 | 105 | 0,00 | |
| Total Suisse | | 31 341 | 1,44 | (e)(f) | | | | 8,250 % éch. 25/04/2040 | € 2 400 | 3 442 | 0,16 | | |
| ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | |
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. | | | | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. | | | | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. | | | | | |
| 4,875 % éch. 25/07/2033 | 4 300 | 4 268 | 0,20 | Lloyds Banking Group PLC | \$ 1 600 | 1 532 | 0,07 | TP ICAP Finance PLC | 2,625 % éch. 18/11/2028 | 300 | 320 | 0,01 | |
| ROYAUME-UNI | | | | 4,582 % éch. 10/12/2025 | 2 000 | 1 959 | 0,09 | 7,875 % éch. 17/04/2030 | 1 200 | 1 632 | 0,08 | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | |
| Anglian Water Services Financing PLC | | | | Anglian Water Services Financing PLC | | | | Anglian Water Services Financing PLC | | | | | |
| 2,750 % éch. 26/10/2029 | € 100 | 116 | 0,01 | 5,985 % éch. 07/08/2027 | 4 900 | 4 989 | 0,23 | Travis Perkins PLC | 3,750 % éch. 17/02/2026 | 1 000 | 1 203 | 0,06 | |
| Assura Financing PLC | | | | 6,942 % éch. 07/08/2027 | 1 400 | 1 402 | 0,06 | (h) | | | | | |
| 1,625 % éch. 30/06/2033 | 1 200 | 1 148 | 0,05 | London & Quadrant Housing Trust | 2,000 % éch. 31/03/2032 | € 1 400 | 1 456 | 0,07 | Virgin Money UK PLC | 4,000 % éch. 25/09/2026 | 200 | 245 | 0,01 |
| Barclays PLC | | | | LSEGA Financing PLC | 2,500 % éch. 06/04/2031 | \$ 3 000 | 2 570 | 0,12 | 4,000 % éch. 03/09/2027 | 3 000 | 3 631 | 0,17 | |
| 2,667 % éch. 10/03/2032 | \$ 1 000 | 825 | 0,04 | 3,200 % éch. 06/04/2041 | 1 000 | 775 | 0,04 | 4,625 % éch. 29/10/2028 | € 500 | 552 | 0,03 | | |
| 2,894 % éch. 24/11/2032 | 300 | 246 | 0,01 | Marks & Spencer PLC | € 300 | 370 | 0,02 | Vmed O2 UK Financing PLC | 3,250 % éch. 31/01/2031 | 700 | 713 | 0,03 | |
| 4,918 % éch. 08/08/2030 | € 1 150 | 1 325 | 0,06 | 4,500 % éch. 10/07/2027 | € 300 | 370 | 0,02 | 4,500 % éch. 15/07/2031 | € 1 000 | 1 106 | 0,05 | | |
| 5,501 % éch. 09/08/2028 | \$ 300 | 302 | 0,01 | Motability Operations Group PLC | 1,500 % éch. 20/01/2041 | 400 | 322 | 0,01 | Vodafone Group PLC | 5,125 % éch. 04/06/2081 | \$ 2 659 | 2 012 | 0,09 |
| 5,746 % éch. 09/08/2033 | 3 350 | 3 392 | 0,16 | 3,500 % éch. 17/07/2031 | € 2 300 | 2 609 | 0,12 | Weir Group PLC | 2,200 % éch. 13/05/2026 | 11 800 | 10 976 | 0,51 | |
| 6,224 % éch. 09/05/2034 | 4 400 | 4 566 | 0,21 | National Grid PLC | 3,875 % éch. 16/01/2029 | 1 600 | 1 818 | 0,08 | Workspace Group PLC | 2,250 % éch. 11/03/2028 | € 1 600 | 1 752 | 0,08 |
| 7,090 % éch. 06/11/2029 | € 3 000 | 4 077 | 0,19 | Nationwide Building Society | 4,302 % éch. 08/03/2029 | \$ 900 | 863 | 0,04 | Yorkshire Building Society | 3,511 % éch. 11/10/2030 | 2 400 | 2 742 | 0,13 |
| 7,325 % éch. 02/11/2026 | \$ 800 | 827 | 0,04 | 4,500 % éch. 01/11/2026 | € 3 900 | 4 446 | 0,21 | 6,375 % éch. 15/11/2028 | 2 000 | 2 603 | 0,12 | | |
| 7,437 % éch. 02/11/2033 | 2 300 | 2 577 | 0,12 | | | | | | | | | | |
| Berkeley Group PLC | | | | | | | | | | | | | |
| 2,500 % éch. 11/08/2031 | € 3 550 | 3 503 | 0,16 | | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Fiserv, Inc. 3,000 % éch. 01/07/2031 | £ 100 | \$ 115 | 0,01 | 6,070 % éch. 22/10/2027 | \$ 2 100 | \$ 2 161 | 0,10 | Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % éch. 01/04/2053 | \$ 3 200 | \$ 3 481 | 0,16 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % éch. 19/07/2024 | € 900 | 980 | 0,05 | 6,087 % éch. 23/10/2029 | 2 900 | 3 051 | 0,14 | Pacific Life Global Funding 1,375 % éch. 14/04/2026 | 605 | 559 | 0,03 |
| 3,021 % éch. 06/03/2024 | 300 | 330 | 0,02 | JPMorgan Chase Bank N.A. 6,402 % éch. 08/12/2026 | 3 000 | 3 012 | 0,14 | 1,600 % éch. 21/09/2028 | 1 000 | 858 | 0,04 |
| 4,535 % éch. 06/03/2025 | £ 400 | 503 | 0,02 | Kaiser Foundation Hospitals 2,810 % éch. 01/06/2041 | 2 850 | 2 137 | 0,10 | 2,450 % éch. 11/01/2032 | 2 000 | 1 660 | 0,08 |
| 4,675 % éch. 01/12/2024 | € 200 | 221 | 0,01 | Kilroy Realty LP 2,650 % éch. 15/11/2033 | 6 400 | 4 860 | 0,22 | 6,216 % éch. 06/12/2024 | 2 000 | 1 992 | 0,09 |
| 6,798 % éch. 07/11/2028 | \$ 1 750 | 1 832 | 0,08 | 3,050 % éch. 15/02/2030 | 400 | 341 | 0,02 | Pacific LifeCorp. 3,350 % éch. 15/09/2050 | 200 | 145 | 0,01 |
| FS KKR Capital Corp. 3,125 % éch. 12/10/2028 | 1 300 | 1 134 | 0,05 | Lazard Group LLC 4,375 % éch. 11/03/2029 | 200 | 194 | 0,01 | PacifiCorp 5,350 % éch. 01/12/2053 | 1 200 | 1 156 | 0,05 |
| Gap, Inc. 3,625 % éch. 01/10/2029 | 550 | 471 | 0,02 | Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % éch. 23/05/2059 | € 200 | 216 | 0,01 | 5,500 % éch. 15/05/2054 | 4 700 | 4 622 | 0,21 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 1,000 % éch. 16/12/2025 | £ 200 | 244 | 0,01 | Liberty Utilities Finance GP 2,050 % éch. 15/09/2030 | \$ 1 800 | 1 461 | 0,07 | Penn Mutual Life Insurance Co. 3,800 % éch. 29/04/2061 | 1 800 | 1 216 | 0,06 |
| 1,500 % éch. 07/12/2027 | 800 | 913 | 0,04 | Low Income Investment Fund 3,711 % éch. 01/07/2029 | 300 | 269 | 0,01 | Physicians Realty LP 3,950 % éch. 15/01/2028 | 800 | 763 | 0,04 |
| 1,542 % éch. 10/09/2027 | \$ 400 | 363 | 0,02 | McLaren Health Care Corp. 4,386 % éch. 15/05/2048 | 200 | 174 | 0,01 | Piedmont Operating Partnership LP 9,250 % éch. 20/07/2028 | 3 100 | 3 277 | 0,15 |
| 1,875 % éch. 16/12/2030 | £ 1 100 | 1 170 | 0,05 | Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,300 % éch. 22/02/2029 | 2 979 | 2 952 | 0,14 | PNC Bank N.A. 2,700 % éch. 22/10/2029 | 600 | 526 | 0,02 |
| 1,992 % éch. 27/01/2032 | \$ 1 000 | 808 | 0,04 | Micron Technology, Inc. 2,703 % éch. 15/04/2032 | 1 800 | 1 513 | 0,07 | PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % éch. 26/01/2027 | 5 880 | 5 836 | 0,27 |
| 2,383 % éch. 21/07/2032 | 900 | 740 | 0,03 | MidAmerican Energy Co. 2,700 % éch. 01/08/2052 | 1 250 | 810 | 0,04 | Principal Life Global Funding 1,250 % éch. 16/08/2026 | 2 750 | 2 495 | 0,12 |
| 2,615 % éch. 22/04/2032 | 7 400 | 6 214 | 0,29 | 3,150 % éch. 15/04/2050 | 1 650 | 1 181 | 0,05 | 1,375 % éch. 10/01/2025 | 2 000 | 1 922 | 0,09 |
| 2,640 % éch. 24/02/2028 | 3 300 | 3 060 | 0,14 | 3,650 % éch. 01/08/2048 | 4 629 | 3 679 | 0,17 | Prologis Euro Finance LLC 1,500 % éch. 08/02/2034 | € 3 250 | 2 941 | 0,14 |
| 2,650 % éch. 21/10/2032 | 900 | 750 | 0,03 | 3,950 % éch. 01/08/2047 | 1 060 | 890 | 0,04 | Prologis LP 2,250 % éch. 15/01/2032 | \$ 600 | 501 | 0,02 |
| 3,102 % éch. 24/02/2033 | 1 100 | 945 | 0,04 | 5,850 % éch. 15/09/2054 | 600 | 665 | 0,03 | Protective Life Global Funding 1,618 % éch. 15/04/2026 | 800 | 739 | 0,03 |
| 3,125 % éch. 25/07/2029 | £ 400 | 473 | 0,02 | Moody's Corp. 2,000 % éch. 19/08/2031 | 700 | 581 | 0,03 | 1,737 % éch. 21/09/2030 | 800 | 649 | 0,03 |
| 3,691 % éch. 05/06/2028 | \$ 500 | 478 | 0,02 | 2,550 % éch. 18/08/2060 | 500 | 289 | 0,01 | 1,900 % éch. 06/07/2028 | 300 | 266 | 0,01 |
| 4,452 % éch. 30/04/2024 | € 300 | 332 | 0,02 | 3,100 % éch. 29/11/2061 | 400 | 271 | 0,01 | 6,469 % éch. 11/12/2024 | 5 000 | 5 022 | 0,23 |
| 5,900 % éch. 02/05/2024 | AUD 2 000 | 1 366 | 0,06 | 3,250 % éch. 15/01/2028 | 300 | 287 | 0,01 | Providence St. Joseph Health Obligated Group 5,403 % éch. 01/10/2033 | 2 900 | 2 956 | 0,14 |
| Golub Capital BDC, Inc. 7,050 % éch. 05/12/2028 | \$ 4 100 | 4 302 | 0,20 | Morgan Stanley 1,102 % éch. 29/04/2033 | € 600 | 539 | 0,02 | Public Service Co. of Colorado 2,700 % éch. 15/01/2051 | 625 | 394 | 0,02 |
| Goodman U.S. Finance Five LLC 4,625 % éch. 04/05/2032 | 4 100 | 3 821 | 0,18 | 1,375 % éch. 27/10/2026 | 1 350 | 1 418 | 0,07 | 3,200 % éch. 01/03/2050 | 2 827 | 2 032 | 0,09 |
| Great-West Lifeco Finance LP 4,047 % éch. 17/05/2028 | 500 | 487 | 0,02 | 1,928 % éch. 28/04/2032 | \$ 8 900 | 7 160 | 0,33 | Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % éch. 15/08/2031 | 2 800 | 2 323 | 0,11 |
| Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % éch. 24/03/2029 | 2 550 | 2 413 | 0,11 | 3,875 % éch. 27/01/2026 | 11 743 | 11 507 | 0,53 | 3,150 % éch. 15/08/2051 | 3 900 | 2 677 | 0,12 |
| Hanover Insurance Group, Inc. 2,500 % éch. 01/09/2030 | 300 | 246 | 0,01 | 5,050 % éch. 28/01/2027 | 1 000 | 1 001 | 0,05 | Public Service Electric & Gas Co. 3,100 % éch. 15/03/2032 | 2 950 | 2 636 | 0,12 |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. 5,000 % éch. 27/07/2028 | 3 300 | 3 332 | 0,15 | 5,123 % éch. 01/02/2029 | 8 100 | 8 141 | 0,38 | 4,650 % éch. 15/03/2033 | 3 200 | 3 203 | 0,15 |
| HAT Holdings LLC 3,375 % éch. 15/06/2026 | 255 | 240 | 0,01 | 6,342 % éch. 18/10/2033 | 6 000 | 6 473 | 0,30 | Qorvo, Inc. 1,750 % éch. 15/12/2024 | 4 900 | 4 704 | 0,22 |
| 3,750 % éch. 15/09/2030 | 3 200 | 2 699 | 0,12 | MSCI, Inc. 3,250 % éch. 15/08/2033 | 1 200 | 1 004 | 0,05 | Quanta Services, Inc. 0,950 % éch. 01/10/2024 | 3 000 | 2 892 | 0,13 |
| 8,000 % éch. 15/06/2027 | 4 100 | 4 275 | 0,20 | 3,625 % éch. 01/09/2030 | 500 | 453 | 0,02 | 2,900 % éch. 01/10/2030 | 5 500 | 4 829 | 0,22 |
| HCA, Inc. 4,125 % éch. 15/06/2029 | 4 700 | 4 497 | 0,21 | 3,875 % éch. 15/02/2031 | 200 | 183 | 0,01 | Realty Income Corp. 1,750 % éch. 13/07/2033 | £ 2 000 | 1 940 | 0,09 |
| 4,500 % éch. 15/02/2027 | 1 700 | 1 681 | 0,08 | 4,000 % éch. 15/11/2029 | 100 | 94 | 0,00 | Reinsurance Group of America, Inc. 6,000 % éch. 15/09/2033 | \$ 1 500 | 1 574 | 0,07 |
| 5,000 % éch. 15/03/2024 | 2 000 | 1 997 | 0,09 | Mutual of Omaha Cos. Global Funding 5,450 % éch. 12/12/2028 | 2 100 | 2 146 | 0,10 | Reliance Steel & Aluminum Co. 2,150 % éch. 15/08/2030 | 1 000 | 845 | 0,04 |
| Healthpeak OP LLC 2,125 % éch. 01/12/2028 | 1 750 | 1 540 | 0,07 | Netflix, Inc. 3,625 % éch. 15/06/2030 | € 500 | 563 | 0,03 | RELX Capital, Inc. 4,000 % éch. 18/03/2029 | 700 | 689 | 0,03 |
| Host Hotels & Resorts LP 2,900 % éch. 15/12/2031 | 2 900 | 2 435 | 0,11 | 3,875 % éch. 15/11/2029 | 3 400 | 3 892 | 0,18 | Retail Opportunity Investments Partnership LP 6,750 % éch. 15/10/2028 | 1 200 | 1 262 | 0,06 |
| 3,375 % éch. 15/12/2029 | 4 800 | 4 314 | 0,20 | Neuberger Berman Group LLC 4,875 % éch. 15/04/2045 | \$ 200 | 166 | 0,01 | RGA Global Funding 2,700 % éch. 18/01/2029 | 1 000 | 888 | 0,04 |
| 3,875 % éch. 01/04/2024 | 100 | 99 | 0,00 | New York State Electric & Gas Corp. 2,150 % éch. 01/10/2031 | 400 | 319 | 0,01 | S&P Global, Inc. 2,700 % éch. 01/03/2029 | 5 500 | 5 090 | 0,23 |
| 4,000 % éch. 15/06/2025 | 500 | 489 | 0,02 | 5,850 % éch. 15/08/2033 | 2 000 | 2 096 | 0,10 | Salesforce, Inc. 1,500 % éch. 15/07/2028 | 1 750 | 1 557 | 0,07 |
| 4,500 % éch. 01/02/2026 | 100 | 98 | 0,00 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % éch. 15/06/2028 | 7 830 | 6 954 | 0,32 | San Diego Gas & Electric Co. 2,950 % éch. 15/08/2051 | 1 750 | 1 234 | 0,06 |
| Hudson Pacific Properties LP 3,250 % éch. 15/01/2030 | 200 | 147 | 0,01 | NextEra Energy Operating Partners LP 7,250 % éch. 15/01/2029 | 5 000 | 5 238 | 0,24 | Santander Holdings USA, Inc. 2,490 % éch. 06/01/2028 | 1 400 | 1 283 | 0,06 |
| 3,950 % éch. 01/11/2027 | 300 | 251 | 0,01 | Niagara Mohawk Power Corp. 1,960 % éch. 27/06/2030 | 4 000 | 3 322 | 0,15 | SBA Tower Trust 1,631 % éch. 15/05/2051 | 1 000 | 894 | 0,04 |
| 5,950 % éch. 15/02/2028 | 3 600 | 3 186 | 0,15 | 5,783 % éch. 16/09/2052 | 2 690 | 2 789 | 0,13 | SCE Recovery Funding LLC 4,697 % éch. 15/06/2042 | 1 928 | 1 904 | 0,09 |
| Humana, Inc. 1,350 % éch. 03/02/2027 | 1 250 | 1 128 | 0,05 | Northern States Power Co. 2,600 % éch. 01/06/2051 | 1 300 | 852 | 0,04 | | | | |
| 3,700 % éch. 23/03/2029 | 1 700 | 1 634 | 0,08 | 2,900 % éch. 01/03/2050 | 1 700 | 1 194 | 0,06 | | | | |
| 3,950 % éch. 15/03/2027 | 95 | 93 | 0,00 | NSTAR Electric Co. 3,100 % éch. 01/06/2051 | 1 675 | 1 181 | 0,05 | | | | |
| 5,875 % éch. 01/03/2033 | 3 000 | 3 197 | 0,15 | 4,950 % éch. 15/09/2052 | 3 900 | 3 811 | 0,18 | | | | |
| IQVIA, Inc. 5,700 % éch. 15/05/2028 | 3 000 | 3 059 | 0,14 | Nuveen LLC 4,000 % éch. 01/11/2028 | 300 | 293 | 0,01 | | | | |
| John Deere Capital Corp. 3,350 % éch. 18/04/2029 | 1 900 | 1 822 | 0,08 | Oracle Corp. 3,950 % éch. 25/03/2051 | (g) | 300 | 235 | 0,01 | | | |
| Jones Lang LaSalle, Inc. 6,875 % éch. 01/12/2028 | 1 000 | 1 060 | 0,05 | Organon & Co. 4,125 % éch. 30/04/2028 | 300 | 276 | 0,01 | | | | |
| JPMorgan Chase & Co. 1,045 % éch. 19/11/2026 | 1 500 | 1 390 | 0,06 | | | | | | | | |
| 2,545 % éch. 08/11/2032 | 8 750 | 7 304 | 0,34 | | | | | | | | |
| 2,580 % éch. 22/04/2032 | 7 400 | 6 263 | 0,29 | | | | | | | | |
| 2,739 % éch. 15/10/2030 | 1 800 | 1 602 | 0,07 | | | | | | | | |
| 4,203 % éch. 23/07/2029 | 1 500 | 1 459 | 0,07 | | | | | | | | |
| 4,323 % éch. 26/04/2028 | 4 500 | 4 435 | 0,20 | | | | | | | | |
| 4,912 % éch. 25/07/2033 | 5 600 | 5 539 | 0,26 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ServiceNow, Inc. 1,400 % éch. 01/09/2030 | \$ 3 200 | \$ 2 632 | 0,12 | 2,700 % éch. 15/06/2031 | 1 100 | 943 | 0,04 | Obligations University of Pittsburgh of the Commonwealth System of Higher Education, Pennsylvania Revenue Bonds, Series 2017 | \$ 2 000 | \$ 1 785 | 0,08 |
| SLM Corp. 3,125 % éch. 02/11/2026 | 1 400 | 1 307 | 0,06 | Verizon Communications, Inc. 0,375 % éch. 22/03/2029 | € 800 | 769 | 0,04 | | | | |
| Solar Star Funding LLC 5,375 % éch. 30/06/2035 | 4 199 | 4 170 | 0,19 | 1,500 % éch. 18/09/2030 | \$ 5 560 | 4 583 | 0,21 | | | | |
| Southern California Edison Co. 2,500 % éch. 01/06/2031 | 200 | 172 | 0,01 | 2,100 % éch. 22/03/2028 | 700 | 634 | 0,03 | | | | |
| 2,750 % éch. 01/02/2032 | 2 500 | 2 153 | 0,10 | 2,850 % éch. 03/09/2041 | 1 550 | 1 146 | 0,05 | | | | |
| 3,600 % éch. 01/02/2045 | 1 600 | 1 246 | 0,06 | 3,400 % éch. 22/03/2041 | 500 | 398 | 0,02 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| 3,650 % éch. 01/06/2051 | 2 500 | 1 887 | 0,09 | 3,700 % éch. 22/03/2061 | 261 | 200 | 0,01 | Freddie Mac | | | |
| 3,900 % éch. 01/12/2041 | 100 | 82 | 0,00 | 2,950 % éch. 08/02/2029 | 2 400 | 2 328 | 0,11 | 0,375 % éch. 23/09/2025 | 1 700 | 1 587 | 0,07 |
| 4,500 % éch. 01/09/2040 | 190 | 171 | 0,01 | 4,329 % éch. 21/09/2028 | 600 | 594 | 0,03 | 1,020 % éch. 25/08/2029 | 2 318 | 100 | 0,00 |
| 4,875 % éch. 01/03/2049 | 200 | 184 | 0,01 | 5,050 % éch. 09/05/2033 | 2 000 | 2 041 | 0,09 | (a) | | | |
| 5,950 % éch. 01/11/2032 | 3 750 | 4 031 | 0,19 | VF Corp. | | | | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | |
| Southwestern Electric Power Co. 3,250 % éch. 01/11/2051 | 3 200 | 2 163 | 0,10 | 2,950 % éch. 23/04/2030 | 3 500 | 2 922 | 0,13 | 3,000 % éch. 01/07/2052 | 6 514 | 5 767 | 0,27 |
| Southwestern Public Service Co. 5,150 % éch. 01/06/2052 | 2 000 | 1 815 | 0,08 | 4,250 % éch. 07/03/2029 | € 500 | 532 | 0,02 | 3,500 % éch. 01/12/2052 | 98 | 90 | 0,00 |
| Spirit Realty LP 4,450 % éch. 15/09/2026 | 100 | 98 | 0,00 | VMware LLC 4,700 % éch. 15/05/2030 | \$ 3 000 | 2 961 | 0,14 | 4,000 % éch. 01/12/2052 - 01/07/2053 | 20 414 | 19 310 | 0,89 |
| Standard Industries, Inc. 2,250 % éch. 21/11/2026 | € 1 600 | 1 677 | 0,08 | Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % éch. 15/03/2032 | 4 100 | 3 754 | 0,17 | 4,500 % éch. 01/07/2052 - 01/07/2053 | 28 795 | 27 930 | 1,29 |
| State Street Corp. 5,751 % éch. 04/11/2026 | \$ 2 600 | 2 642 | 0,12 | 5,391 % éch. 15/03/2062 | 500 | 429 | 0,02 | 5,000 % éch. 01/02/2053 | 23 660 | 23 414 | 1,08 |
| Stryker Corp. 4,850 % éch. 08/12/2028 | 2 500 | 2 530 | 0,12 | Wells Fargo & Co. 4,540 % éch. 15/08/2026 | 3 100 | 3 069 | 0,14 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| Synchrony Financial 2,875 % éch. 28/10/2031 | 500 | 401 | 0,02 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 4,700 % éch. 15/09/2028 | 2 500 | 2 474 | 0,11 | 4,000 % éch. 01/01/2054 | 35 570 | 33 665 | 1,55 |
| 4,250 % éch. 15/08/2024 | 1 000 | 989 | 0,05 | Weyerhaeuser Co. 4,000 % éch. 15/11/2029 | 3 000 | 2 870 | 0,13 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 111 500 | 113 220 | 5,22 |
| 4,375 % éch. 19/03/2024 | 650 | 648 | 0,03 | 6,875 % éch. 15/12/2033 | 70 | 77 | 0,00 | | | | |
| 7,250 % éch. 02/02/2033 | 800 | 794 | 0,04 | Wisconsin Electric Power Co. 4,750 % éch. 30/09/2032 | 1 250 | 1 261 | 0,06 | | | | |
| T-Mobile USA, Inc. 2,550 % éch. 15/02/2031 | 2 000 | 1 724 | 0,08 | Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % éch. 01/04/2033 | 8 249 | 8 275 | 0,38 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| 2,625 % éch. 15/02/2029 | 1 000 | 901 | 0,04 | Wisconsin Public Service Corp. 2,850 % éch. 01/12/2051 | 2 250 | 1 490 | 0,07 | Obligations du Trésor américain | | | |
| 3,300 % éch. 15/02/2051 | 900 | 651 | 0,03 | WP Carey, Inc. 2,450 % éch. 01/02/2032 | 1 200 | 976 | 0,05 | 1,875 % éch. 15/02/2041 | 13 050 | 9 390 | 0,43 |
| 3,600 % éch. 15/11/2060 | 300 | 219 | 0,01 | Xylem, Inc. 2,250 % éch. 30/01/2031 | 1 080 | 926 | 0,04 | (h) | 39 500 | 28 586 | 1,32 |
| Tapestry, Inc. 5,350 % éch. 27/11/2025 | € 2 000 | 2 256 | 0,10 | | | | | 2,250 % éch. 15/05/2041 | 28 900 | 22 028 | 1,02 |
| 5,375 % éch. 27/11/2027 | 1 600 | 1 832 | 0,08 | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | 2,375 % éch. 15/02/2042 | 58 900 | 45 217 | 2,08 |
| 5,875 % éch. 27/11/2031 | 800 | 930 | 0,04 | Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,455 % éch. 08/11/2030 | 1 200 | 1 206 | 0,06 | (h) | 38 800 | 34 059 | 1,57 |
| 7,850 % éch. 27/11/2033 | \$ 3 500 | 3 735 | 0,17 | | | | | (h) | 9 700 | 8 653 | 0,40 |
| Teachers Insurance & Annuity Association of America 4,270 % éch. 15/05/2047 | 400 | 349 | 0,02 | OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX | | | | 3,875 % éch. 15/05/2043 | 10 100 | 9 632 | 0,44 |
| Topaz Solar Farms LLC 5,750 % éch. 30/09/2039 | 1 271 | 1 265 | 0,06 | Obligations California Health Facilities Financing Authority Revenue Bonds, Series 2022 | 4 190 | 1 946 | 0,09 | (h) | 27 600 | 26 831 | 1,24 |
| Toyota Motor Credit Corp. 3,050 % éch. 22/03/2027 | 1 300 | 1 246 | 0,06 | Obligations University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022 | 3 504 | 1 075 | 0,05 | 4,000 % éch. 15/11/2042 | 33 800 | 36 266 | 1,67 |
| Travel + Leisure Co. 5,650 % éch. 01/04/2024 | 300 | 300 | 0,01 | | | | | 4,750 % éch. 15/11/2043 | 33 800 | 36 266 | 1,67 |
| Truist Financial Corp. 1,267 % éch. 02/03/2027 | 1 900 | 1 740 | 0,08 | | | | | (i) | | | |
| 4,873 % éch. 26/01/2029 | 5 250 | 5 176 | 0,24 | | | | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) | | | |
| 5,122 % éch. 26/01/2034 | 2 750 | 2 665 | 0,12 | | | | | 0,125 % éch. 15/10/2024 | 1 199 | 1 173 | 0,05 |
| U.S. Bancorp 5,727 % éch. 21/10/2026 | 1 800 | 1 813 | 0,08 | | | | | 0,125 % éch. 15/02/2051 | 6 382 | 3 956 | 0,18 |
| 5,836 % éch. 12/06/2034 | 600 | 619 | 0,03 | | | | | 0,250 % éch. 15/01/2025 | 4 806 | 4 666 | 0,22 |
| U.S. Bank N.A. 2,800 % éch. 27/01/2025 | \$ 600 | \$ 584 | 0,03 | | | | | 0,625 % éch. 15/07/2032 | 31 874 | 29 139 | 1,34 |
| UnitedHealth Group, Inc. 5,350 % éch. 15/02/2033 | 1 400 | 1 482 | 0,07 | | | | | 1,375 % éch. 15/07/2033 | 12 562 | 12 188 | 0,56 |
| 5,875 % éch. 15/02/2053 | 3 100 | 3 514 | 0,16 | | | | | 1,500 % éch. 15/02/2053 | 4 244 | 3 852 | 0,18 |
| USAA Capital Corp. 2,125 % éch. 01/05/2030 | 1 000 | 841 | 0,04 | | | | | Billets du Trésor américain | | | |
| 3,375 % éch. 01/05/2025 | 1 300 | 1 274 | 0,06 | | | | | 0,750 % éch. 30/04/2026 | 7 400 | 6 847 | 0,32 |
| VeriSign, Inc. | | | | | | | | 3,125 % éch. 31/08/2027 | 3 250 | 3 159 | 0,15 |
| | | | | | | | | 4,250 % éch. 31/05/2025 | 30 800 | 30 692 | 1,41 |
| | | | | | | | | (h) | 310 | 313 | 0,01 |
| | | | | | | | | 4,625 % éch. 15/03/2026 | | | |
| | | | | | | | | STRIPS du Trésor américain | | | |
| | | | | | | | | 0,000 % éch. 15/05/2046 | 2 200 | 857 | 0,04 |
| | | | | | | | | (c) | | | |
| | | | | | | | | | 317 504 | 14,63 | |
| | | | | | | | | Total États-Unis | 1 210 249 | 55,77 | |
| | | | | | | | | ÎLES VIERGES BRITANNIQUES | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | TSMC Global Ltd. | | | |
| | | | | | | | | 1,250 % éch. 23/04/2026 | 3 600 | 3 325 | 0,15 |
| | | | | | | | | Total des Valeurs mobilières | \$ 2 410 642 | 111,08 | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (recue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-----------------------------|------------------|--|--|---------------------|
| SSB | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 1 300 | Billets du Trésor américain | \$ (1 326) | \$ 1 300 | \$ 1 300 | 0,06 |
| | | | | | éch. 31/07/2025 | | | | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (1 326) | \$ 1 300 | \$ 1 300 | 0,06 |

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 357 | \$ 812 | 0,04 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 80 | 330 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 315 | (686) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 609 | (2 924) | (0,14) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 178 | (2 220) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Long | 03/2024 | 85 | 63 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 19 | (161) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 465 | 1 008 | 0,05 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 91 | (246) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 562 | (1 996) | (0,09) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 938 | (4 244) | (0,20) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 145 | 1 308 | 0,06 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 208 | (1 813) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 131 | (896) | (0,04) |
| | | | | \$ (11 665) | (0,54) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (11 665) | (0,54) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|---|------------------------|
| Ally Financial, Inc. | 5,000 % | 20/12/2027 | \$ 1 100 | \$ 11 | 0,00 |
| American International Group, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 900 | 1 | 0,00 |
| American International Group, Inc. | 1,000 | 20/12/2027 | 1 000 | 1 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 2 500 | 1 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 700 | 0 | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/12/2025 | € 100 | 0 | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/12/2027 | 300 | 1 | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/06/2028 | 3 200 | 12 | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/12/2028 | 400 | 2 | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20/12/2028 | \$ 4 200 | 24 | 0,01 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2027 | 600 | 2 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2024 | 300 | 0 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2024 | 800 | 0 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 3 000 | 2 | 0,00 |
| Mellife, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 1 700 | 2 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20/06/2028 | € 1 000 | 3 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/06/2028 | 600 | 2 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | \$ 700 | 1 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 2 200 | 3 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2027 | 700 | 1 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 6 700 | 16 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 1 700 | 4 | 0,00 |
| | | | | \$ 89 | 0,01 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|------------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 % | 15/06/2024 | \$ 40 600 | \$ (739) | (0,03) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,785 | 12/08/2051 | 800 | (20) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,000 | 16/06/2026 | CAD 13 800 | 28 | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,220 | 03/03/2025 | 600 | (6) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,235 | 04/03/2025 | 1 100 | (10) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,275 | 03/03/2025 | 600 | (6) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,276 | 03/03/2025 | 300 | (3) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,290 | 03/03/2025 | 200 | (2) | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,500 | 17/06/2030 | 500 | 3 | 0,00 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/09/2025 | 43 900 | (44) | 0,00 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,000 | 21/06/2025 | 181 400 | 181 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,600 | 15/12/2050 | € 2 300 | (24) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 16 600 | (343) | (0,02) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 30 400 | 445 | 0,02 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 68 300 | 768 | 0,03 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 10 700 | 62 | 0,00 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,475 | 16/06/2031 | \$ 2 600 | 4 | 0,00 |
| | | | | | \$ 294 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 383 | 0,02 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement italien | 1,000 % | 20/12/2026 | \$ 2 300 | \$ 11 | \$ 26 | \$ 37 | 0,00 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--------|
| AZD | 01/2024 | AUD | \$ 3 865 | \$ 2 559 | \$ 0 | \$ (78) | 0,00 | |
| BOA | 01/2024 | | 691 | 457 | 0 | (15) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 21 606 | 27 356 | 0 | (188) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 4 624 | ¥ 682 388 | 219 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 610 | NOK 6 491 | 29 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 113 | SEK 1 182 | 4 | 0 | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | € | 231 522 | \$ 254 340 | 0 | (1 470) | (0,07) | |
| | 01/2024 | £ | 10 398 | 13 189 | 0 | (67) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 398 600 | 2 764 | 0 | (65) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 035 | CAD 1 368 | 3 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 32 223 | \$ 1 738 | 0 | (22) | 0,00 | |
| BRC | 01/2024 | € | 341 824 | 375 931 | 0 | (1 751) | (0,08) | |
| | 01/2024 | \$ | 1 272 | £ 1 004 | 8 | 0 | 0,00 | |
| CBK | 01/2024 | BRL | 31 624 | \$ 6 495 | 0 | (15) | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 4 276 | 4 612 | 0 | (113) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 1 076 | CAD 1 455 | 28 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 147 | NOK 1 570 | 8 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | BRL | 5 349 | \$ 1 043 | 0 | (57) | 0,00 | |
| | 04/2024 | \$ | 6 495 | BRL 31 945 | 27 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | CAD | 29 892 | \$ 21 996 | 0 | (676) | (0,03) | |
| | 01/2024 | \$ | 6 406 | BRL 31 643 | 108 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 2 226 | ¥ 327 303 | 97 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 2 | BRL 9 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | AUD | 1 813 | \$ 1 202 | 0 | (35) | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 8 609 | 9 293 | 0 | (219) | (0,01) | |
| | 01/2024 | £ | 175 | 223 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 30 846 | 1 614 | 0 | (71) | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | £ | 69 | 88 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | SEK | 23 761 | 2 389 | 31 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 20 | CHF 17 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 2 506 | € 2 256 | 0 | (14) | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 2 770 | £ 2 169 | 0 | (5) | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 758 | ¥ 259 216 | 82 | 0 | 0,00 | |
| RYL | 01/2024 | CHF | 4 560 | \$ 5 299 | 0 | (121) | (0,01) | |
| SCX | 01/2024 | SEK | 13 502 | 1 300 | 0 | (40) | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | AUD | 1 728 | 1 147 | 0 | (33) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 59 300 | 75 043 | 0 | (555) | (0,03) | |
| | 01/2024 | \$ | 3 384 | NOK 36 105 | 171 | 0 | 0,01 | |
| | | | | | \$ 815 | \$ (5 610) | \$ (4 795) | (0,22) |

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 87 | \$ 102 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 116 | CHF 99 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CHF 90 | \$ 104 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 10 141 | CHF 8 845 | 374 | 0 | 374 | 0,02 |
| CBK | 01/2024 | CHF 358 | \$ 414 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 230 | CHF 200 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CHF 236 | \$ 270 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 70 687 | CHF 61 946 | 2 951 | 0 | 2 951 | 0,14 |
| MYI | 01/2024 | CHF 281 | \$ 323 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 71 049 | CHF 62 020 | 2 679 | 0 | 2 679 | 0,12 |
| SCX | 01/2024 | CHF 138 | \$ 164 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 63 468 | CHF 55 381 | 2 367 | 0 | 2 367 | 0,11 |
| | | | | \$ 8 382 | \$ (38) | \$ 8 344 | 0,39 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 7 091 | \$ 7 783 | \$ 17 | \$ (70) | \$ (53) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 298 936 | € 271 895 | 1 481 | 0 | 1 481 | 0,07 |
| BRC | 01/2024 | 281 817 | 256 249 | 1 313 | 0 | 1 313 | 0,06 |
| CBK | 01/2024 | € 2 482 | \$ 2 734 | 4 | (12) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 513 | € 469 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 2 404 | \$ 2 627 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 152 | € 140 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 281 865 | 256 249 | 1 266 | 0 | 1 266 | 0,06 |
| | | | | \$ 4 088 | \$ (112) | \$ 3 976 | 0,18 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et E en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 793 | \$ 1 003 | \$ 0 | \$ (8) | \$ (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 12 601 | £ 9 947 | 80 | 0 | 80 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 4 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 10 038 | £ 7 914 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 1 758 | \$ 2 234 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 48 | £ 38 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 2 522 | 1 979 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 2 167 | \$ 2 759 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 67 355 | £ 53 473 | 815 | 0 | 815 | 0,04 |
| MYI | 01/2024 | £ 551 | \$ 704 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 67 160 | £ 53 371 | 880 | 0 | 880 | 0,04 |
| RYL | 01/2024 | 64 362 | 50 849 | 462 | 0 | 462 | 0,02 |
| SCX | 01/2024 | 72 609 | 57 404 | 572 | 0 | 572 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | £ 48 | \$ 60 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 80 292 | £ 63 441 | 586 | 0 | 586 | 0,03 |
| | | | | \$ 3 450 | \$ (21) | \$ 3 429 | 0,16 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 120 378 | SEK 1 255 579 | \$ 4 240 | \$ 0 | \$ 4 240 | 0,19 |
| BRC | 01/2024 | 513 | 5 257 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | SEK 1 370 | \$ 131 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 31 588 | SEK 328 483 | 1 039 | (25) | 1 014 | 0,05 |
| GLM | 01/2024 | SEK 7 276 | \$ 697 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 434 | SEK 24 916 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 2 534 | 25 712 | 30 | (12) | 18 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 140 199 | 1 456 102 | 4 322 | 0 | 4 322 | 0,20 |
| UAG | 01/2024 | 141 726 | 1 462 553 | 3 437 | (2) | 3 435 | 0,16 |
| | | | | \$ 13 116 | \$ (69) | \$ 13 047 | 0,60 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 24 038 1,11

Total des Investissements

\$ 2 424 698 111,73

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (254 491) (11,73)

Actifs nets

\$ 2 170 207 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
 (b) Titre à rémunération en nature.
 (c) Titre à coupon zéro.
 (d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
 (e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
 (f) Titre convertible conditionnel.
 (g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,87 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------------|---------|-----------------|--------------|-----------|--------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 4,850 % | 25/05/2047 | 23/09/2021 | \$ 1 322 | \$ 1 058 | 0,05 |
| Brookfield Property Finance ULC | 7,125 | 13/02/2028 | 09/02/2023 | 820 | 821 | 0,04 |
| Citigroup, Inc. | 2,572 | 03/06/2031 | 29/12/2021 | 8 152 | 6 923 | 0,32 |
| Citigroup, Inc. | 6,075 | 25/01/2026 | 18/01/2022 | 2 000 | 1 989 | 0,09 |
| Deutsche Bank AG | 1,447 | 01/04/2025 | 23/09/2021 | 2 001 | 1 976 | 0,09 |
| Deutsche Bank AG | 2,129 | 24/11/2026 | 29/11/2023 | 368 | 375 | 0,02 |
| Oracle Corp. | 3,950 | 25/03/2051 | 22/03/2021 | 300 | 235 | 0,01 |
| | | | | \$ 14 963 | \$ 13 377 | 0,62 |

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 106 702 \$ (31 décembre 2022 : 74 895 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(i) Un titre d'une juste valeur globale de 36 266 \$ (31 décembre 2022 : 22 792 \$) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 25 394 \$ (31 décembre 2022 : 28 652 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 560 \$ (31 décembre 2022 : 1 380 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 2 410 642 | \$ 0 | \$ 2 410 642 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 300 | 0 | 1 300 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (5 681) | 18 437 | 0 | 12 756 |
| Totaux | \$ (5 681) | \$ 2 430 379 | \$ 0 | \$ 2 424 698 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 489 771 | \$ 0 | \$ 1 489 771 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 15 240 | 0 | 15 240 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 3 729 | 11 595 | 0 | 15 324 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (5 887) | 0 | (5 887) |
| Totaux | \$ 3 729 | \$ 1 510 719 | \$ 0 | \$ 1 514 448 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BOS | 5,350 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ (2 190) | \$ (2 191) | (0,10) |
| BPS | 4,300 | 22/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (614) | (617) | (0,03) |
| BRC | 5,500 | 14/12/2023 | 04/01/2024 | (30 646) | (30 730) | (1,42) |
| JML | 1,000 | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | £ (998) | (1 274) | (0,06) |
| | 4,100 | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (377) | (481) | (0,02) |
| MBC | 3,400 | 15/08/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (342) | (382) | (0,02) |
| SCX | 5,750 | 28/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (72 311) | (72 357) | (3,33) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (108 032) | (4,98) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BPG | (0,500) % | 28/12/2023 | 02/01/2024 | \$ (36 863) | \$ (36 861) | (1,70) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (36 861) | (1,70) |

⁽¹⁾ Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 \$ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (78) | \$ 0 | \$ (78) | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | 4 398 | (5 630) | (1 232) | 631 | (740) | (109) |
| BPS | (141) | 0 | (141) | 1 | 0 | 1 |
| BRC | (50) | 560 | 510 | 524 | (240) | 284 |
| CBK | 874 | (1 340) | (466) | 7 658 | (7 770) | (112) |
| GLM | 2 486 | (2 440) | 46 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | S/O | S/O | S/O | (244) | 0 | (244) |
| MBC | 476 | (570) | (94) | (1 588) | 1 380 | (208) |
| MYI | 3 642 | (4 170) | (528) | 312 | (100) | 212 |
| RYL | 341 | (570) | (229) | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 4 854 | (6 830) | (1 976) | 4 744 | (4 520) | 224 |
| UAG | 7 236 | (5 610) | 1 626 | 1 133 | (520) | 613 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 84,95 | 81,73 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 26,04 | 26,66 |
| Autres valeurs mobilières | 0,09 | 0,36 |
| Contrats de mise en pension | 0,06 | 1,11 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,54) | 0,46 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,02 | (0,30) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 1,11 | 0,96 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (0,43) |
| Contrats de prise en pension | (4,98) | (5,54) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (1,70) | (5,54) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Australie | 0,45 | 0,41 |
| Autriche | 0,37 | 0,22 |
| Belgique | 1,46 | 0,65 |
| Bésil | 0,03 | 0,02 |
| Canada | 2,31 | 1,75 |
| Îles Caïmans | 0,09 | 0,27 |
| Chili | 0,32 | 0,44 |
| Colombie | S/O | 0,09 |
| Chypre | S/O | 0,08 |
| République tchèque | 0,21 | S/O |
| Danemark | 1,29 | 0,79 |
| Finlande | 0,60 | 0,63 |
| France | 6,61 | 5,16 |
| Allemagne | 2,66 | 2,94 |
| Guernesey, Îles Anglo-normandes | 0,23 | 0,32 |
| Hong Kong | 0,36 | 0,01 |
| Inde | 0,39 | 0,96 |
| Indonésie | 0,03 | S/O |
| Irlande | 1,04 | 1,40 |
| Italie | 1,62 | 1,33 |
| Japon | 3,84 | 3,85 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 0,05 | 0,09 |
| Luxembourg | 0,85 | 1,23 |
| Île Maurice | 0,21 | 0,18 |
| Mexique | 0,37 | 0,32 |
| Multinationales | 0,32 | 0,63 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Pays-Bas | 8,70 | 7,21 |
| Nouvelle-Zélande | 0,03 | S/O |
| Norvège | 0,28 | 0,16 |
| Pérou | 0,08 | 0,11 |
| Pologne | 0,07 | S/O |
| Roumanie | 0,31 | 0,29 |
| Serbie | 0,08 | 0,13 |
| Singapour | 0,32 | 0,35 |
| Afrique du Sud | S/O | 0,02 |
| Corée du Sud | 1,95 | 1,02 |
| Espagne | 1,82 | 1,34 |
| Supranationales | 3,75 | 2,90 |
| Suède | 0,52 | 0,70 |
| Suisse | 1,44 | 0,63 |
| Émirats arabes unis | 0,20 | S/O |
| Royaume-Uni | 9,90 | 8,14 |
| États-Unis | 55,77 | 55,93 |
| Îles Vierges britanniques | 0,15 | 0,24 |
| Instruments à court terme | S/O | 5,81 |
| Contrats de mise en pension | 0,06 | 1,11 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,54) | 0,46 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | (0,02) |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,01 | (0,28) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Options sur titres | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,22) | (0,50) |
| Contrats de change à terme couverts | 1,33 | 1,46 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (0,43) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (11,73) | (10,55) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|--|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | |
| AUSTRALIE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement australien | | | |
| 0,750 % éch. 21/11/2027 | AUD 13 315 | \$ 8 983 | 0,76 |
| 3,000 % éch. 20/09/2025 | 6 440 | 4 521 | 0,39 |
| Total Australie | | 13 504 | 1,15 |
| CANADA | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien | | | |
| 4,250 % éch. 01/12/2026 (d) | CAD 2 709 | 2 228 | 0,19 |
| ÎLES CAIMANS | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | |
| 6,805 % éch. 16/01/2030 | \$ 1 075 | 1 074 | 0,09 |
| Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. | | | |
| 6,755 % éch. 15/10/2030 | 1 093 | 1 094 | 0,09 |
| Sound Point CLO Ltd. | | | |
| 6,605 % éch. 15/04/2029 | 993 | 993 | 0,09 |
| Total Îles Caïmans | | 3 161 | 0,27 |
| DANEMARK | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Jyske Realkredit A/S | | | |
| 0,500 % éch. 01/10/2053 | DKK 369 | 40 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 18 | 2 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 2 746 | 297 | 0,03 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 490 | 58 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 15 133 | 1 727 | 0,15 |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 | 3 | 0 | 0,00 |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab | | | |
| 0,500 % éch. 01/10/2043 | 10 231 | 1 233 | 0,10 |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 1 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 | 13 | 2 | 0,00 |
| Nykredit Realkredit A/S | | | |
| 0,500 % éch. 01/10/2053 | 2 958 | 316 | 0,03 |
| 1,000 % éch. 01/01/2024 | 12 900 | 1 912 | 0,16 |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 83 150 | 9 886 | 0,84 |
| 2,000 % éch. 01/10/2053 | 8 595 | 1 052 | 0,09 |
| 2,500 % éch. 01/10/2047 | 2 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % éch. 01/10/2053 | 49 467 | 6 887 | 0,59 |
| 3,500 % éch. 01/10/2053 | 3 172 | 455 | 0,04 |
| 5,000 % éch. 01/10/2053 | 7 141 | 1 062 | 0,09 |
| Realkredit Danmark A/S | | | |
| 1,000 % éch. 01/01/2024 | 31 600 | 4 683 | 0,40 |
| 1,000 % éch. 01/10/2050 | 7 343 | 852 | 0,07 |
| 1,000 % éch. 01/10/2053 | 6 212 | 712 | 0,06 |
| 1,500 % éch. 01/10/2050 | 16 175 | 1 899 | 0,16 |
| 1,500 % éch. 01/10/2053 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % éch. 01/04/2047 | 8 | 1 | 0,00 |
| 3,000 % éch. 01/10/2053 | 26 557 | 3 692 | 0,31 |
| Total Danemark | | 36 768 | 3,12 |
| FRANCE | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| FCT CA Leasing | | | |
| 4,736 % éch. 26/02/2042 | € 3 166 | 3 509 | 0,30 |
| Ginkgo Personal Loans | | | |
| 4,666 % éch. 23/09/2044 | 4 100 | 4 543 | 0,38 |
| | | 8 052 | 0,68 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement français | | | |
| 0,100 % éch. 01/03/2025 (d)(f) | 10 239 | 11 149 | 0,95 |
| 0,100 % éch. 01/03/2026 (d) | 4 016 | 4 394 | 0,37 |
| 0,100 % éch. 01/03/2028 (d) | 14 451 | 15 758 | 1,34 |
| 0,100 % éch. 01/03/2029 (d) | 596 | 654 | 0,06 |
| 0,100 % éch. 25/07/2031 (d) | 8 162 | 8 891 | 0,75 |
| 0,100 % éch. 25/07/2036 (d) | 244 | 255 | 0,02 |
| 0,100 % éch. 25/07/2038 (d) | 232 | 241 | 0,02 |
| 0,250 % éch. 25/07/2024 (d) | 15 484 | 16 992 | 1,44 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|--|------------------------------|
| 0,550 % éch. 01/03/2039 (d) | € 3 005 | \$ 3 279 | 0,28 |
| 1,850 % éch. 25/07/2027 (d) | 14 175 | 16 562 | 1,41 |
| | | 78 175 | 6,64 |
| Total France | | 86 227 | 7,32 |
| ALLEMAGNE | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Retail Automotive CP Germany UG | | | |
| 4,553 % éch. 21/07/2034 | 2 775 | 3 071 | 0,26 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | | | |
| 3,125 % éch. 10/10/2028 | 26 000 | 29 663 | 2,52 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| République d'Allemagne | | | |
| 0,100 % éch. 15/04/2026 (d) | 21 232 | 23 068 | 1,96 |
| Total Allemagne | | 55 802 | 4,74 |
| IRLANDE | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Adagio CLO DAC | | | |
| 4,882 % éch. 10/10/2031 | 3 000 | 3 277 | 0,28 |
| Ares European CLO DAC | | | |
| 4,575 % éch. 15/04/2030 | 5 464 | 5 989 | 0,51 |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | 4 145 | 4 536 | 0,38 |
| 4,843 % éch. 20/04/2032 | 2 000 | 2 175 | 0,18 |
| Aurium CLO DAC | | | |
| 4,966 % éch. 23/03/2032 | 1 700 | 1 863 | 0,16 |
| Bain Capital Euro CLO DAC | | | |
| 4,773 % éch. 20/04/2032 | 293 | 321 | 0,03 |
| Barings Euro CLO DAC | | | |
| 4,918 % éch. 27/07/2031 | 1 499 | 1 637 | 0,14 |
| Cairn CLO DAC | | | |
| 4,745 % éch. 15/10/2031 | 1 699 | 1 846 | 0,16 |
| Carlyle Euro CLO DAC | | | |
| 4,665 % éch. 15/01/2031 | 793 | 868 | 0,07 |
| Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC | | | |
| 4,623 % éch. 15/12/2032 | 2 691 | 2 985 | 0,25 |
| Fidelity Grand Harbour CLO DAC | | | |
| 5,125 % éch. 15/03/2032 | 3 480 | 3 831 | 0,33 |
| Harvest CLO DAC | | | |
| 4,815 % éch. 15/01/2032 | 1 600 | 1 745 | 0,15 |
| 4,872 % éch. 18/11/2030 | 1 707 | 1 869 | 0,16 |
| Madison Park Euro Funding DAC | | | |
| 4,696 % éch. 25/10/2030 | 3 277 | 3 567 | 0,30 |
| Man GLG Euro CLO DAC | | | |
| 5,779 % éch. 15/10/2036 | 2 100 | 2 325 | 0,20 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | | |
| 0,000 % éch. 15/05/2033 | 2 000 | 2 204 | 0,19 |
| 5,015 % éch. 15/10/2031 | 5 312 | 5 802 | 0,49 |
| 5,589 % éch. 15/01/2033 | 5 900 | 6 551 | 0,56 |
| Palmerston Park CLO DAC | | | |
| 4,625 % éch. 18/04/2030 | 797 | 877 | 0,07 |
| St. Paul's CLO DAC | | | |
| 4,786 % éch. 25/04/2030 | 4 968 | 5 432 | 0,46 |
| | | 59 700 | 5,07 |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | |
| Delos Aircraft DAC | | | |
| 7,348 % éch. 31/10/2027 | \$ 40 | 40 | 0,00 |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Dilosk RBMS DAC | | | |
| 4,956 % éch. 20/10/2062 | € 2 446 | 2 714 | 0,23 |
| European Loan Conduit DAC | | | |
| 4,994 % éch. 17/02/2030 | 1 242 | 1 354 | 0,12 |
| Glenbeigh Issuer DAC | | | |
| 4,666 % éch. 24/06/2050 | 4 615 | 5 095 | 0,43 |
| Primrose Residential DAC | | | |
| 4,626 % éch. 24/03/2061 | 3 067 | 3 378 | 0,29 |
| Shamrock Residential DAC | | | |
| 5,126 % éch. 24/02/2071 | 2 762 | 3 046 | 0,26 |
| | | 15 587 | 1,33 |
| Total Irlande | | 75 327 | 6,40 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR L'ACTIF (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|--|------------------------------|
| ITALIE | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Marzio Finance SRL | | | |
| 4,955 % éch. 28/02/2048 | € 2 239 | \$ 2 483 | 0,21 |
| Red & Black Auto Italy SRL | | | |
| 4,865 % éch. 28/07/2034 | 3 011 | 3 341 | 0,29 |
| | | 5 824 | 0,50 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| UniCredit SpA | | | |
| 3,375 % éch. 31/01/2027 | 4 100 | 4 586 | 0,39 |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 0,400 % éch. 15/05/2030 (d) | 3 598 | 3 715 | 0,31 |
| 0,650 % éch. 15/05/2026 (d) | 3 783 | 4 116 | 0,35 |
| 1,400 % éch. 26/05/2025 (d) | 40 928 | 44 501 | 3,78 |
| 1,500 % éch. 15/05/2029 (d) | 33 001 | 36 557 | 3,11 |
| 2,350 % éch. 15/09/2024 (d) | 57 364 | 63 520 | 5,40 |
| 2,400 % éch. 15/05/2039 (d) | 11 351 | 13 006 | 1,10 |
| | | 165 415 | 14,05 |
| Total Italie | | 175 825 | 14,94 |
| JAPON | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement japonais | | | |
| 0,100 % éch. 10/09/2024 (d) | ¥595 650 | 4 291 | 0,36 |
| 0,100 % éch. 10/03/2025 (d) | 1 402 905 | 10 200 | 0,87 |
| 0,100 % éch. 10/03/2026 (d) | 2 917 121 | 21 509 | 1,83 |
| 0,100 % éch. 10/03/2028 (d) | 2 694 714 | 20 089 | 1,71 |
| 0,100 % éch. 10/03/2029 (d) | 2 554 639 | 19 090 | 1,62 |
| Total Japon | | 75 179 | 6,39 |
| LUXEMBOURG | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Bavarian Sky S.A. | | | |
| 4,309 % éch. 20/11/2031 | € 3 100 | 3 427 | 0,29 |
| Compartment VCL | | | |
| 4,273 % éch. 21/08/2029 | 2 609 | 2 884 | 0,25 |
| Driver UK Multi-Compartment S.A. | | | |
| 5,847 % éch. 25/04/2031 | £ 3 100 | 3 959 | 0,34 |
| Pony S.A. Compartment German Auto Loans | | | |
| 4,502 % éch. 14/11/2032 | € 3 300 | 3 656 | 0,31 |
| SC Germany S.A. Compartment Consumer | | | |
| 4,578 % éch. 15/09/2037 | 2 900 | 3 217 | 0,27 |
| | | 17 143 | 1,46 |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Miravet SARL | | | |
| 4,806 % éch. 26/05/2065 | 1 871 | 2 050 | 0,17 |
| Total Luxembourg | | 19 193 | 1,63 |
| PAYS-BAS | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Dutch Property Finance BV | | | |
| 4,852 % éch. 28/04/2064 | 1 801 | 1 995 | 0,17 |
| Eurosail BV | | | |
| 5,485 % éch. 17/10/2040 | 96 | 106 | 0,01 |
| Total Pays-Bas | | 2 101 | 0,18 |
| NOUVELLE-ZÉLANDE | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais | | | |
| 2,000 % éch. 20/09/2025 | NZD 10 475 | 6 611 | 0,56 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|---|----------------------------------|--------------------------------|-------------------|------|-------------------------------------|-------|--|-------|-------|------|----------------------------------|-----|------|--|-------|------|--|--|
| 3,000 % éch. 20/09/2030 | NZD 1 301 | \$ 859 | 0,07 | Lanebrook Mortgage Transaction PLC | £ 2 753 | \$ 3 485 | 0,30 | 6,238 % éch. 20/10/2072 | \$ 5 021 | \$ 4 925 | 0,42 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Total Nouvelle-Zélande | | 7 470 | 0,63 | 5,871 % éch. 20/07/2058 | | | | 6,246 % éch. 20/08/2068 | 1 043 | 1 023 | 0,09 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| PÉROU | | | | London Wall Mortgage Capital PLC | | 790 | 1 002 | 0,09 | 6,338 % éch. 20/03/2073 | 5 692 | 5 613 | 0,48 | | | | | | | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 6,020 % éch. 15/05/2052 | | | | 6,438 % éch. 20/05/2073 | 3 255 | 3 272 | 0,28 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | | Mortimer BTL PLC | | | | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5,940 % éch. 12/02/2029 | PEN 700 | 189 | 0,02 | 5,920 % éch. 23/06/2053 | 2 637 | 3 342 | 0,28 | 4,500 % éch. 01/08/2052 | 993 | 964 | 0,08 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| SLOVÉNIE | | | | Polaris PLC | | 2 186 | 2 773 | 0,24 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Precise Mortgage Funding PLC | | 199 | 253 | 0,02 | 4,000 % éch. 01/02/2054 | 30 500 | 28 876 | 2,45 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Nova Ljubljanska Banka d.d. | | | | 6,420 % éch. 12/12/2055 | 813 | 1 037 | 0,09 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 56 300 | 54 613 | 4,63 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3,400 % éch. 05/02/2030 | € 600 | 575 | 0,05 | RMAC PLC | | 3 000 | 3 837 | 0,33 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 26 900 | 27 315 | 2,32 | | | | | | | | | | | | | | | |
| ESPAGNE | | | | 0,000 % éch. 15/02/2047 | | | | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 18 500 | 18 957 | 1,61 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | RMAC Securities PLC | | 1 388 | 1 709 | 0,15 | | | 154 897 | 13,15 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Autonoría Spain | | | | 5,489 % éch. 12/06/2044 | | | | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4,576 % éch. 30/09/2041 | 2 600 | 2 881 | 0,25 | Rochester Financing PLC | | 2 618 | 3 313 | 0,28 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| BBVA Consumer Auto | | | | 5,920 % éch. 18/12/2044 | | | | 0,125 % éch. 15/10/2024 (f) | 57 322 | 56 077 | 4,76 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 0,270 % éch. 20/07/2031 | 155 | 168 | 0,01 | Stratton BTL Mortgage Funding PLC | | 3 501 | 4 450 | 0,38 | 0,125 % éch. 15/04/2025 (g) | 55 472 | 53 497 | 4,54 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 3 049 | 0,26 | 5,951 % éch. 20/01/2054 | | | | 0,125 % éch. 15/10/2025 (f) | 53 123 | 51 089 | 4,34 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Stratton Mortgage Funding PLC | | 5 602 | 7 092 | 0,60 | 0,125 % éch. 15/04/2026 (g) | 54 003 | 51 411 | 4,37 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | | 5,920 % éch. 12/12/2043 | 687 | 876 | 0,07 | 0,125 % éch. 15/07/2026 (f) | 72 259 | 68 865 | 5,85 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 0,700 % éch. 30/11/2033 (d) | 4 503 | 4 813 | 0,41 | 6,120 % éch. 12/03/2052 | | | | 0,125 % éch. 15/10/2026 (f) | 71 160 | 67 588 | 5,74 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Total Espagne | | 7 862 | 0,67 | Towd Point Mortgage Funding PLC | | 2 792 | 3 564 | 0,30 | 0,125 % éch. 15/01/2027 | 22 775 | 21 406 | 1,82 | | | | | | | | | | | | | | | |
| SUPRANATIONALES | | | | 6,571 % éch. 20/07/2045 | | 1 925 | 2 461 | 0,21 | 0,125 % éch. 15/01/2030 | 2 272 | 2 060 | 0,18 | | | | | | | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Tower Bridge Funding PLC | | 0,000 % éch. 20/01/2066 | | | 0,125 % éch. 15/07/2030 | 6 360 | 5 749 | 0,49 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Union européenne | | | | (a) | 2 100 | 2 682 | 0,23 | 0,125 % éch. 15/07/2031 | 4 913 | 4 371 | 0,37 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3,125 % éch. 05/12/2028 | 4 000 | 4 555 | 0,39 | 5,940 % éch. 20/12/2063 | | 789 | 1 001 | 0,08 | 0,125 % éch. 15/01/2032 | 1 665 | 1 463 | 0,12 | | | | | | | | | | | | | | | |
| SUÈDE | | | | 6,000 % éch. 20/11/2063 | | 3 351 | 4 262 | 0,36 | 0,125 % éch. 15/02/2051 | 355 | 220 | 0,02 | | | | | | | | | | | | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 6,721 % éch. 20/10/2064 | | 4 374 | 5 609 | 0,48 | 0,250 % éch. 15/01/2025 (f) | 73 654 | 71 498 | 6,07 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement suédois | | | | Tudor Rose Mortgages | | 1 194 | 1 514 | 0,13 | 0,250 % éch. 15/02/2050 | 479 | 313 | 0,03 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 0,125 % éch. 01/06/2026 | SEK50 623 | 4 922 | 0,42 | 5,820 % éch. 20/06/2048 | | | | 0,375 % éch. 15/07/2025 (f) | 58 643 | 56 824 | 4,83 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 0,125 % éch. 01/12/2027 | 5 401 | 523 | 0,04 | Twin Bridges PLC | | 2 246 | 2 840 | 0,24 | 0,375 % éch. 15/01/2027 (f) | 70 181 | 66 709 | 5,67 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1,000 % éch. 01/06/2025 | 65 222 | 6 428 | 0,55 | 5,880 % éch. 12/09/2055 | | 2 101 | 2 682 | 0,23 | 0,375 % éch. 15/07/2027 | 48 424 | 46 026 | 3,91 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Total Suède | | 11 873 | 1,01 | 6,470 % éch. 12/12/2054 | | | | 0,500 % éch. 15/01/2028 (f) | 108 020 | 102 247 | 8,69 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| SUISSE | | | | | | 87 002 | 7,39 | 0,625 % éch. 15/01/2028 (f) | 66 595 | 64 265 | 5,46 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 0,625 % éch. 15/07/2032 | 7 307 | 6 680 | 0,57 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Credit Suisse AG | | | | Bon du Trésor britannique | | | | 0,750 % éch. 15/07/2028 | 30 766 | 29 453 | 2,50 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5,779 % éch. 02/02/2024 | \$ 1 650 | 1 649 | 0,14 | 0,125 % éch. 22/03/2024 | 31 077 | 39 262 | 3,34 | 0,750 % éch. 15/02/2045 | 1 960 | 1 534 | 0,13 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| UBS Group AG | | | | (d) | | 206 | 262 | 0,02 | 0,875 % éch. 15/01/2029 (f) | 54 101 | 51 795 | 4,40 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4,965 % éch. 16/01/2026 | € 600 | 664 | 0,05 | 0,125 % éch. 22/03/2026 | | | | 0,875 % éch. 15/02/2047 | 765 | 603 | 0,05 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 6,537 % éch. 12/08/2033 | \$ 750 | 801 | 0,07 | (d) | | 60 639 | 81 572 | 6,93 | 1,375 % éch. 15/07/2033 | 6 686 | 6 487 | 0,55 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Total Suisse | | 3 114 | 0,26 | 1,250 % éch. 22/11/2027 | | 13 300 | 15 702 | 1,33 | 1,375 % éch. 15/02/2044 | 1 188 | 1 063 | 0,09 | | | | | | | | | | | | | | | |
| ROYAUME-UNI | | | | 1,625 % éch. 22/10/2028 | | | | 1,625 % éch. 15/10/2027 (f) | 64 396 | 63 926 | 5,43 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | 136 798 | 11,62 | 2,125 % éch. 15/02/2041 | 843 | 867 | 0,07 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Alba PLC | | | | | | | | | | 954 086 | 81,05 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5,509 % éch. 17/03/2039 | £ 747 | 924 | 0,08 | Total Royaume-Uni | | | | | | 223 800 | 19,01 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Atlas Funding PLC | | | | ÉTATS-UNIS | | | | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 6,120 % éch. 25/07/2058 | 2 020 | 2 577 | 0,22 | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | BILLETS DE TRÉSORERIE | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Avon Finance PLC | | | | Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates | | | | AT+T, Inc. | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 0,000 % éch. 28/12/2049 | 3 000 | 3 816 | 0,32 | 6,370 % éch. 25/10/2034 | | | | \$ 312 | 316 | 0,03 | 5,700 % éch. 19/03/2024 | | | | 3 800 | 3 752 | 0,32 | | | | | | | | | | |
| Canada Square Funding PLC | | | | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | 1 868 | | | | 1 665 | 0,14 | | | | | | | | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 17/06/2058 | 1 483 | 1 882 | 0,16 | 6,410 % éch. 25/05/2034 | | | | | | | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 6,070 % éch. 17/01/2059 | 3 467 | 4 394 | 0,37 | Structured Asset Investment Loan Trust | | | | 734 | | | | 724 | 0,06 | | | | | | | | | | | | | | |
| 6,170 % éch. 17/06/2058 | 1 312 | 1 670 | 0,14 | 6,420 % éch. 25/10/2033 | | | | | | | 10,900 % éch. | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Canterbury Finance PLC | | | | | | | | | | | | 04/01/2024 (b)(c) | | | | HUF 929 000 | 2 683 | 0,23 | | | | | | | | | |
| 6,046 % éch. 16/05/2058 | 2 525 | 3 213 | 0,27 | | | | | 2 705 | | | | 2,705 | 0,23 | Total des Instruments à court terme | | | | 6 435 | 0,55 | | | | | | | | |
| Eurosail PLC | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | ACTIONS | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4,108 % éch. 13/03/2045 | € 467 | 513 | 0,04 | Sabine Pass Liquefaction LLC | | | | 5,750 % éch. 15/05/2024 | | | | 100 | | | | 100 | 0,01 | | | | | | | | | | |
| 4,219 % éch. 10/06/2044 | 449 | 494 | 0,04 | | | | | | | | | | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | | | | | | | | |
| 4,219 % éch. 10/09/2044 | 719 | 789 | 0,07 | | | | | | | | | | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | | | | | | | | |
| 5,489 % éch. 13/03/2045 | £ 580 | 735 | 0,06 | | | | | | | | | | | | | PIMCO Select Funds plc - | | | | | | | | | | | |
| Friary PLC | | | | | | | | | | | | | | | | Fonds PIMCO US Dollar | | | | | | | | | | | |
| 0,000 % éch. 21/10/2071 | 2 300 | 2 942 | 0,25 | | | | | | | | | | | | | Short-Term Floating NAV | | | | | | | | | | | |
| Great Hall Mortgages PLC | | | | | | | | | | | | | | | | Fund (e) | | | | 50 773 | 506 | 0,04 | | | | | |
| 5,469 % éch. 18/03/2039 | 9 | 12 | 0,00 | | | | | | | | | | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement | | | | \$506 | 0,04 | | |
| 5,489 % éch. 18/06/2038 | 180 | 229 | 0,02 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Jupiter Mortgage PLC | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 6,021 % éch. 20/07/2060 | 2 375 | 3 028 | 0,26 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net | |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 2 889 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | \$ (2 947) | \$ 2 889 | \$ 2 890 | 0,25 | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | \$ (2 947) | \$ 2 889 | \$ 2 890 | 0,25 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Court | 09/2025 | 438 | \$ (378) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Long | 09/2026 | 438 | 297 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 16 | (37) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 182 | (389) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Court | 03/2024 | 304 | (931) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 491 | (2 040) | (0,17) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 29 | (367) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 15 | (62) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 1 032 | (650) | (0,06) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 148 | (146) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 1 374 | (3 364) | (0,29) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 377 | 1 446 | 0,12 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 271 | (1 561) | (0,13) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 183 | 1 040 | 0,09 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 217 | (2 754) | (0,23) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 12 | 107 | 0,01 |
| | | | | \$ (9 789) | (0,83) |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|-----------------|-------------------|------------------|---------|--------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation EUREX Euro-Bund février 2024 | € 137,000 | 26/01/2024 | 51 | \$ (37) | \$ (79) | (0,01) |
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor avril 2024 | 96,750 | 12/04/2024 | 420 | (284) | (285) | (0,02) |
| | | | | | (364) | (0,03) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | | \$ (10 153) | (0,86) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 % | 20/03/2029 | £ 23 300 | \$ (1 697) | (0,14) |
| À payer ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 34 900 | 549 | 0,05 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 16/06/2029 | ¥ 1 952 000 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,237 | 21/11/2053 | \$ 8 700 | 1 693 | 0,14 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,340 | 21/11/2028 | 43 000 | (2 448) | (0,21) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,865 | 13/02/2054 | 13 500 | 780 | 0,07 |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,085 | 13/02/2034 | 44 400 | (966) | (0,08) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400 | 23/02/2033 | 2 700 | (45) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 7 300 | (78) | (0,01) |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 22/03/2026 | 23 700 | 40 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 68 000 | (621) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,868 | 22/12/2025 | 23 700 | (247) | (0,02) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 41 660 | (5 042) | (0,43) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 148 920 | 9 334 | 0,79 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2044 | 1 400 | (192) | (0,02) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 16 400 | 656 | 0,06 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 54 500 | (962) | (0,08) |
| À payer | CPTFEMU | 1,355 | 15/02/2050 | 1 200 | (54) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 1,375 | 15/02/2040 | 1 600 | (151) | (0,01) |
| À payer | CPTFEMU | 1,946 | 15/03/2048 | 800 | (134) | (0,01) |
| À payer | CPTFEMU | 2,356 | 15/11/2033 | 4 200 | 103 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,359 | 15/08/2030 | 1 500 | 36 | 0,00 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | CPTFEMU | 2,363 % | 15/11/2033 | € 2 300 | \$ 54 | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,390 | 15/11/2033 | 2 400 | 62 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,488 | 15/05/2037 | 2 290 | (72) | (0,01) |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,548 | 15/11/2053 | 700 | (22) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,580 | 15/03/2052 | 1 400 | (57) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,590 | 15/12/2052 | 1 700 | 57 | 0,00 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,620 | 15/11/2053 | 1 500 | (91) | (0,01) |
| À payer | CPTFEMU | 2,700 | 15/04/2053 | 5 500 | 500 | 0,04 |
| À payer | CPTFEMU | 2,763 | 15/09/2053 | 2 400 | 255 | 0,02 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,975 | 15/08/2027 | 19 700 | (153) | (0,01) |
| À recevoir | CPTFEMU | 3,000 | 15/05/2027 | 5 400 | 44 | 0,00 |
| À recevoir | CPTFEMU | 3,130 | 15/05/2027 | 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 3,520 | 15/09/2024 | 5 200 | (21) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 3,720 | 15/09/2024 | 3 300 | 0 | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 3,850 | 15/09/2024 | 7 700 | 6 | 0,00 |
| À recevoir | CPURNSA | 1,794 | 24/08/2027 | \$ 6 700 | 177 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 1,798 | 25/08/2027 | 3 400 | 90 | 0,01 |
| À payer | CPURNSA | 1,883 | 20/11/2029 | 7 400 | (197) | (0,02) |
| À recevoir | CPURNSA | 1,890 | 27/08/2027 | 6 500 | 173 | 0,01 |
| À payer | CPURNSA | 1,954 | 03/06/2029 | 4 700 | (128) | (0,01) |
| À payer | CPURNSA | 1,998 | 25/07/2029 | 4 300 | (119) | (0,01) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,311 | 24/02/2031 | 6 600 | 185 | 0,02 |
| À payer | CPURNSA | 2,335 | 05/02/2028 | 6 110 | (187) | (0,02) |
| À payer | CPURNSA | 2,353 | 09/05/2028 | 960 | (29) | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 2,364 | 10/05/2028 | 7 960 | (243) | (0,02) |
| À payer | CPURNSA | 2,379 | 09/07/2028 | 1 900 | (59) | (0,01) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,419 | 05/03/2026 | 400 | 11 | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 2,420 | 24/08/2024 | 17 800 | (9) | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 2,560 | 12/09/2024 | 4 400 | 7 | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 2,565 | 12/09/2024 | 4 200 | 7 | 0,00 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,690 | 01/06/2026 | 1 300 | 37 | 0,00 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,703 | 25/05/2026 | 2 450 | 70 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,768 | 13/05/2026 | 3 500 | 102 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,813 | 14/05/2026 | 1 600 | 47 | 0,00 |
| À payer | FRCPXTOB | 1,280 | 15/11/2034 | € 1 700 | (138) | (0,01) |
| À payer | FRCPXTOB | 1,410 | 15/11/2039 | 2 000 | (152) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,330 | 15/01/2025 | £ 400 | (51) | 0,00 |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,346 | 15/05/2030 | 550 | (39) | 0,00 |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,850 | 15/09/2024 | 2 500 | (338) | (0,03) |
| | | | | | \$ 323 | 0,03 |
| | | | | | \$ 323 | 0,03 |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description | Indice initial | Taux variable | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 100,151 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035 | 1 500 | \$ (68) | \$ (55) | 0,00 |
| JPM | Taux plafond - CPURNSA hors cote | \$ 233,916 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0 | 22/04/2024 | 1 000 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Taux plafond - CPURNSA hors cote | \$ 234,781 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0 | 16/05/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ (76) | \$ (55) | 0,00 |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,700 % | 13/02/2024 | 44 000 | \$ (192) | \$ (651) | (0,05) |
| BRC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 3,150 | 06/10/2025 | 16 800 | (194) | (437) | (0,04) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,150 | 06/10/2025 | 16 800 | (194) | (70) | (0,01) |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,950 | 15/09/2025 | 14 000 | (169) | (327) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,950 | 15/09/2025 | 14 000 | (169) | (77) | (0,01) |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,760 | 16/01/2024 | 39 200 | (182) | (553) | (0,05) |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,900 | 20/03/2024 | 47 400 | (229) | (264) | (0,02) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,900 | 29/08/2025 | 8 800 | (115) | (193) | (0,02) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,900 | 29/08/2025 | 8 800 | (115) | (44) | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,800 | 01/09/2025 | 18 900 | (239) | (385) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,800 | 01/09/2025 | 18 900 | (239) | (105) | (0,01) |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,758 | 16/01/2024 | 4 000 | (18) | (56) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (2 055) | \$ (3 162) | (0,27) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 % | 17/10/2057 | \$ 599 | \$ (40) | \$ 40 | \$ 0 | 0,00 |
| SAL | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 1 400 | (3) | (3) | (6) | 0,00 |
| UAG | Indice CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17/09/2058 | 893 | (79) | 80 | 1 | 0,00 |
| | | | | | \$ (122) | \$ 117 | \$ (5) | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 10 845 | \$ 7 184 | \$ 0 | \$ (218) | (0,02) |
| BOA | 01/2024 | £ | 6 911 | 8 777 | 0 | (32) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 4 500 834 | 30 500 | 0 | (1 446) | (0,12) |
| | 01/2024 | \$ | 100 | MXN 1 702 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 67 588 | \$ 9 402 | 0 | (145) | (0,01) |
| | 06/2024 | KRW | 6 091 275 | 4 682 | 0 | (59) | (0,01) |
| BPS | 01/2024 | DKK | 101 129 | 14 911 | 0 | (79) | (0,01) |
| | 01/2024 | € | 25 619 | 28 201 | 0 | (106) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 27 611 | 35 012 | 0 | (188) | (0,02) |
| | 01/2024 | HUF | 247 002 | 702 | 0 | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 2 624 349 | 17 899 | 0 | (728) | (0,06) |
| | 01/2024 | KRW | 65 689 | 50 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 100 | BRL 491 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 932 | DKK 19 910 | 19 | 19 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 878 | € 1 698 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 182 | £ 1 716 | 5 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 | HUF 405 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 150 | IDR 2 319 926 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 328 | ZAR 80 230 | 54 | 0 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | € | 350 531 | \$ 385 507 | 0 | (1 796) | (0,15) |
| | 01/2024 | KRW | 193 845 | 150 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD | 10 778 | 6 630 | 0 | (194) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ | 2 443 | MXN 42 854 | 77 | 0 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 2 599 | IDR 40 399 626 | 21 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | DKK | 8 095 | \$ 1 186 | 0 | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 93 819 | 268 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR | 2 314 281 | 150 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 048 | £ 828 | 7 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 2 616 | \$ 139 | 0 | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 7 116 | 1 890 | 0 | (28) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 150 | IDR 2 314 875 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | KRW | 129 970 | \$ 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD | 18 747 | 13 797 | 0 | (422) | (0,03) |
| | 01/2024 | DKK | 123 576 | 18 229 | 0 | (89) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ | 1 158 200 | 7 899 | 0 | (321) | (0,03) |
| JPM | 01/2024 | DKK | 44 370 | 6 525 | 0 | (50) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 547 329 | 1 560 | 0 | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 150 | IDR 2 308 050 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 50 | KRW 64 809 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 3 549 | BRL 17 408 | 28 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 64 254 | \$ 50 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | AUD | 4 417 | 2 929 | 0 | (86) | (0,01) |
| | 01/2024 | € | 5 847 | 6 386 | 0 | (75) | (0,01) |
| MYI | 01/2024 | £ | 49 | 63 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 37 894 | 108 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 1 709 711 | 11 597 | 0 | (538) | (0,04) |
| | 01/2024 | \$ | 1 989 | DKK 13 540 | 18 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 460 | € 414 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 570 | £ 447 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 149 | ZAR 2 762 | 2 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 150 | IDR 2 324 475 | 1 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | SEK | 107 612 | \$ 10 361 | 0 | (319) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ | 1 326 | MXN 23 282 | 43 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 221 462 | \$ 7 120 | 0 | (218) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ | 2 373 | INR 198 486 | 4 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | AUD | 3 571 | \$ 2 369 | 0 | (68) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 143 076 | 181 066 | 0 | (1 333) | (0,11) |
| | 01/2024 | ¥ | 180 124 | 1 230 | 0 | (49) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 199 | MXN 3 492 | 7 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 2 256 | INR 188 801 | 5 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 293 | \$ (8 650) | \$ (8 357) | (0,71) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 21 | \$ 25 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | \$ 566 | CHF 494 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | CHF 143 | \$ 165 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ 13 900 | CHF 12 110 | 496 | 0 | 496 | 0,04 |
| | 01/2024 | CHF 27 | \$ 31 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 14 054 | CHF 12 316 | 587 | 0 | 587 | 0,05 |
| MYI | 01/2024 | 14 134 | 12 338 | 533 | 0 | 533 | 0,05 |
| SCX | 01/2024 | CHF 1 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 1 637 | \$ (8) | \$ 1 629 | 0,14 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 13 530 | \$ 14 821 | \$ 0 | \$ (128) | \$ (128) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 1 834 | € 1 673 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 153 797 | 139 843 | 717 | 0 | 717 | 0,06 |
| CBK | 01/2024 | € 3 263 | \$ 3 555 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 4 202 | 4 577 | 0 | (66) | (66) | (0,01) |
| MYI | 01/2024 | \$ 157 658 | € 143 440 | 829 | 0 | 829 | 0,07 |
| UAG | 01/2024 | 157 779 | 143 440 | 709 | 0 | 709 | 0,06 |
| | | | | \$ 2 270 | \$ (244) | \$ 2 026 | 0,17 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 73 | \$ 93 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 563 | £ 2 808 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 70 | \$ 89 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 7 584 | £ 5 979 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 146 | 115 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 577 | \$ 731 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 20 | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 393 | 1 766 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 97 | 123 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | \$ 43 437 | £ 34 341 | 342 | 0 | 342 | 0,03 |
| SSB | 01/2024 | £ 81 | \$ 102 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 31 525 | £ 24 983 | 325 | 0 | 325 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | £ 80 | \$ 100 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 43 430 | £ 34 316 | 318 | 0 | 318 | 0,03 |
| | | | | \$ 1 042 | \$ (20) | \$ 1 022 | 0,09 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 150 987 | SGD 201 348 | \$ 1 697 | \$ 0 | \$ 1 697 | 0,14 |
| BOA | 01/2024 | 150 987 | 201 436 | 1 763 | 0 | 1 763 | 0,15 |
| CBK | 01/2024 | 125 608 | 167 576 | 1 466 | 0 | 1 466 | 0,13 |
| GLM | 01/2024 | 23 742 | 31 688 | 286 | 0 | 286 | 0,02 |
| | | | | \$ 5 212 | \$ 0 | \$ 5 212 | 0,44 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (1 690) (0,14)

Total des Investissements

\$ 1 915 533 162,74

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (738 481) (62,74)

Actifs nets

\$ 1 177 052 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- Titre vendu avant l'émission.
- Titre à coupon zéro.
- Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- Affilié au Fonds.

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 620 826 \$ (31 décembre 2022 : 183 180 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 24 628 \$ (31 décembre 2022 : 79 359 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 3 735 \$ (31 décembre 2022 : 286 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de transactions à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 17 518 \$ (31 décembre 2022 : 13 037 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 7 060 \$ (31 décembre 2022 : 5 380 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 920 976 | \$ 2 682 | \$ 1 923 658 |
| Fonds d'investissement | 506 | 0 | 0 | 506 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 2 889 | 0 | 2 889 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (4 814) | (6 706) | 0 | (11 520) |
| Totaux | \$ (4 308) | \$ 1 917 159 | \$ 2 682 | \$ 1 915 533 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 661 693 | \$ 0 | \$ 1 661 693 |
| Fonds d'investissement | 12 424 | 0 | 0 | 12 424 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 053 | 0 | 1 053 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 2 256 | 18 777 | 0 | 21 033 |
| Totaux | \$ 14 680 | \$ 1 681 523 | \$ 0 | \$ 1 696 203 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BOS | 5,750 % | 28/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (3 869) | \$ (3 872) | (0,33) |
| BRC | 3,950 | 01/11/2023 | 07/02/2024 | € (8 423) | (9 365) | (0,80) |
| CIB | 5,470 | 07/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (602 489) | (604 777) | (51,38) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (618 014) | (52,51) |

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BPG | 5,710 % | 28/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (2 462) | \$ (2 463) | (0,21) |
| TDM | 5,530 | 19/12/2023 | 02/01/2024 | (22 179) | (22 223) | (1,89) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (24 686) | (2,10) |

(1) Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 5 \$ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 1 479 | \$ (1 630) | \$ (151) | \$ 1 129 | \$ (820) | \$ 309 |
| BOA | 97 | 0 | 97 | 2 665 | (2 510) | 155 |
| BPS | (1 764) | 2 020 | 256 | (530) | 450 | (80) |
| BRC | (1 660) | 2 920 | 1 260 | 166 | 0 | 166 |
| CBK | 1 456 | (2 120) | (664) | 6 045 | (6 000) | 45 |

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| DUB | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O | \$ (1 270) | \$ 1 230 | \$ (40) |
| FAR | (553) | 490 | (63) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | (516) | 540 | 24 | 1 583 | (1 500) | 83 |
| GST | (490) | 470 | (20) | (1 050) | 1 130 | 80 |
| JPM | (44) | 0 | (44) | (314) | 640 | 326 |
| MBC | (237) | 310 | 73 | (485) | 340 | (145) |
| MYC | (56) | 0 | (56) | (12) | 30 | 18 |
| MYI | 840 | (1 770) | (930) | (2 046) | 1 530 | (516) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | 317 | (280) | 37 |
| RYL | S/O | S/O | S/O | 773 | (450) | 323 |
| SAL | (6) | 10 | 4 | (11) | 10 | (1) |
| SCX | (148) | 300 | 152 | 5 105 | (4 920) | 185 |
| SSB | 324 | (440) | (116) | S/O | S/O | S/O |
| TOR | S/O | S/O | S/O | 31 | (60) | (29) |
| UAG | (412) | 0 | (412) | (40) | 20 | (20) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 145,93 | 114,97 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 17,21 | 6,69 |
| Autres valeurs mobilières | 0,28 | 0,13 |
| Fonds d'investissement | 0,04 | 0,91 |
| Contrats de mise en pension | 0,25 | 0,08 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,86) | 0,26 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,03 | 0,40 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,14) | 0,88 |
| Contrats de prise en pension | (52,51) | (19,18) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (2,10) | (5,83) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Australie | 1,15 | 1,01 |
| Canada | 0,19 | 0,16 |
| Îles Caïmans | 0,27 | 0,55 |
| Danemark | 3,12 | 3,10 |
| France | 7,32 | 5,15 |
| Allemagne | 4,74 | 4,63 |
| Irlande | 6,40 | 3,76 |
| Italie | 14,94 | 6,49 |
| Japon | 6,39 | 5,03 |
| Luxembourg | 1,63 | 0,17 |
| Pays-Bas | 0,18 | 0,19 |
| Nouvelle-Zélande | 0,63 | 0,52 |
| Pérou | 0,02 | 0,09 |
| Slovénie | 0,05 | 0,04 |
| Espagne | 0,67 | 0,35 |
| Supranationales | 0,39 | S/O |
| Suède | 1,01 | 0,82 |
| Suisse | 0,26 | S/O |
| Royaume-Uni | 19,01 | 14,56 |
| États-Unis | 94,50 | 75,17 |
| Instruments à court terme | 0,55 | S/O |
| Fonds d'investissement | 0,04 | 0,91 |
| Contrats de mise en pension | 0,25 | 0,08 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,83) | 0,26 |
| Options vendues | | |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | (0,03) | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,03 | 0,40 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,27 |
| Options vendues | | |
| Options plafonnées sur l'inflation | 0,00 | (0,01) |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,27) | (0,57) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,71) | (0,55) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,84 | 1,74 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (62,74) | (24,32) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|--------------------------------|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|---|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | 3,500 % éch. 01/10/2053 | | | | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC | | | |
| AUSTRALIE | | | | 5,000 % éch. 01/10/2053 | | | | 4,715 % éch. 15/07/2030 | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Realcredit Danmark A/S | | | | Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC | | | |
| Obligation internationale du gouvernement australien | | | | 1,000 % éch. 01/01/2024 | | | | 4,623 % éch. 15/12/2032 | | | |
| 0,250 % éch. 21/11/2032 | AUD 19 357 | \$ 11 920 | 0,50 | 1,000 % éch. 01/10/2050 | 60 700 | 8 995 | 0,38 | Contego CLO DAC | | | |
| 0,750 % éch. 21/11/2027 | 19 912 | 13 434 | 0,57 | 1,000 % éch. 01/10/2053 | 4 843 | 561 | 0,02 | 4,642 % éch. 23/01/2030 | 1 096 | 1 194 | 0,05 |
| 2,000 % éch. 21/08/2035 | 5 007 | 3 608 | 0,15 | 1,500 % éch. 01/10/2050 | 19 346 | 2 220 | 0,09 | CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | |
| Total Australie | | 28 962 | 1,22 | 1,500 % éch. 01/10/2053 | 50 849 | 5 970 | 0,25 | 4,555 % éch. 15/09/2033 | 2 788 | 3 034 | 0,13 |
| | | | | 1,500 % éch. 01/10/2053 | 108 740 | 12 561 | 0,53 | 4,661 % éch. 27/01/2031 | 980 | 1 068 | 0,04 |
| | | | | 2,500 % éch. 01/04/2047 | 8 | 1 | 0,00 | Dryden Euro CLO DAC | | | |
| | | | | Total Danemark | | 69 412 | 2,92 | 4,625 % éch. 15/04/2033 | 4 178 | 4 549 | 0,19 |
| | | | | | | | | 4,862 % éch. 15/05/2034 | 2 496 | 2 715 | 0,11 |
| | | | | | | | | Euro-Galaxy CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,589 % éch. 24/04/2034 | 5 594 | 6 071 | 0,25 |
| | | | | | | | | Harvest CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 1,040 % éch. 15/07/2031 | 1 000 | 1 046 | 0,04 |
| | | | | | | | | 4,673 % éch. 20/10/2031 | 2 165 | 2 356 | 0,10 |
| | | | | | | | | 4,725 % éch. 15/07/2031 | 7 400 | 8 057 | 0,34 |
| | | | | | | | | 4,815 % éch. 15/01/2032 | 3 700 | 4 037 | 0,17 |
| | | | | | | | | Jubilee CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,565 % éch. 15/04/2030 | 550 | 602 | 0,03 |
| | | | | | | | | 4,615 % éch. 15/04/2031 | 1 700 | 1 846 | 0,08 |
| | | | | | | | | Laurelin DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,713 % éch. 20/10/2031 | 3 610 | 3 949 | 0,17 |
| | | | | | | | | Madison Park Euro Funding DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,765 % éch. 15/07/2032 | 7 300 | 7 955 | 0,33 |
| | | | | | | | | Man GLG Euro CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,645 % éch. 15/10/2030 | 1 838 | 2 018 | 0,08 |
| | | | | | | | | 4,835 % éch. 15/01/2030 | 236 | 261 | 0,01 |
| | | | | | | | | Oak Hill European Credit Partners DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,733 % éch. 20/10/2031 | 1 895 | 2 070 | 0,09 |
| | | | | | | | | OCP Euro CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,882 % éch. 22/09/2034 | 7 300 | 7 949 | 0,33 |
| | | | | | | | | Palmer Square European Loan Funding DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,685 % éch. 15/10/2031 | 3 737 | 4 062 | 0,17 |
| | | | | | | | | 4,695 % éch. 15/07/2031 | 1 973 | 2 153 | 0,09 |
| | | | | | | | | 5,589 % éch. 15/01/2033 | 6 800 | 7 551 | 0,32 |
| | | | | | | | | Purple Finance CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,756 % éch. 25/01/2031 | 582 | 642 | 0,03 |
| | | | | | | | | Segovia European CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,745 % éch. 18/01/2031 | 790 | 866 | 0,04 |
| | | | | | | | | 4,873 % éch. 20/07/2032 | 6 400 | 6 980 | 0,29 |
| | | | | | | | | Tikehau CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,844 % éch. 04/08/2034 | 3 500 | 3 822 | 0,16 |
| | | | | | | | | Toro European CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,812 % éch. 15/02/2034 | 10 300 | 11 223 | 0,47 |
| | | | | | | | | Total Irlande | | 186 158 | 7,82 |
| | | | | | | | | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| | | | | | | | | Dilosk RBMS DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,956 % éch. 20/10/2062 | 4 705 | 5 219 | 0,22 |
| | | | | | | | | European Loan Conduit DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,994 % éch. 17/02/2030 | 2 389 | 2 605 | 0,11 |
| | | | | | | | | Glenbeigh Issuer DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,666 % éch. 24/06/2050 | 10 384 | 11 463 | 0,48 |
| | | | | | | | | Primrose Residential DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,626 % éch. 24/03/2061 | 6 646 | 7 319 | 0,31 |
| | | | | | | | | Shamrock Residential DAC | | | |
| | | | | | | | | 5,126 % éch. 24/02/2071 | 6 387 | 7 044 | 0,29 |
| | | | | | | | | | 33 650 | 1,41 | |
| | | | | | | | | Total Irlande | | 219 808 | 9,23 |
| | | | | | | | | ITALIE | | | |
| | | | | | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| | | | | | | | | Marzio Finance SRL | | | |
| | | | | | | | | 4,955 % éch. 28/02/2048 | 4 384 | 4 862 | 0,20 |
| | | | | | | | | Red & Black Auto Italy SRL | | | |
| | | | | | | | | 4,865 % éch. 28/07/2034 | 5 458 | 6 055 | 0,26 |
| | | | | | | | | | 10 917 | 0,46 | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | UniCredit SpA | | | |
| | | | | | | | | 3,375 % éch. 31/01/2027 | 7 000 | 7 830 | 0,33 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 0,400 % éch. 15/05/2030 (d) | € 26 506 | \$ 27 372 | 1,15 |
| 1,250 % éch. 15/09/2032 (d) | 9 408 | 10 090 | 0,42 |
| 1,300 % éch. 15/05/2028 (d) | 59 282 | 65 462 | 2,75 |
| 1,400 % éch. 26/05/2025 (d) | 70 063 | 76 178 | 3,20 |
| 2,400 % éch. 15/05/2039 (d) | 40 803 | 46 751 | 1,96 |
| 4,100 % éch. 01/02/2029 | 43 400 | 50 281 | 2,11 |
| | 276 134 | 11,59 | |

Total Italie 294 881 12,38

JAPON

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Obligation internationale du gouvernement japonais | | | |
| 0,100 % éch. 10/03/2025 (d) | ¥ 368 900 | 2 682 | 0,11 |
| 0,100 % éch. 10/03/2026 (d) | 3 592 054 | 26 485 | 1,11 |
| 0,100 % éch. 10/03/2028 (d) | 5 035 952 | 37 543 | 1,58 |
| 0,100 % éch. 10/03/2029 (d) | 7 379 236 | 55 143 | 2,32 |
| Total Japon | 121 853 | 5,12 | |

LUXEMBOURG

TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Compartment VCL | | | |
| 4,273 % éch. 21/08/2029 | € 6 242 | 6 901 | 0,29 |
| Driver UK Multi-Compartment S.A. | | | |
| 5,847 % éch. 25/04/2031 | £ 6 000 | 7 662 | 0,32 |
| SC Germany S.A. Compartment Consumer | | | |
| 4,578 % éch. 15/09/2037 | € 5 600 | 6 212 | 0,26 |
| Total Luxembourg | 20 775 | 0,87 | |

PAYS-BAS

TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Eurosail BV | | | |
| 5,485 % éch. 17/10/2040 | 202 | 223 | 0,01 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| BNG Bank NV | | | |
| 0,500 % éch. 21/12/2026 | £ 7 700 | 8 848 | 0,37 |
| Nederlandse Waterschapsbank NV | | | |
| 0,875 % éch. 30/09/2026 | 7 500 | 8 762 | 0,37 |
| | 17 610 | 0,74 | |
| Total Pays-Bas | 17 833 | 0,75 | |

NOUVELLE-ZÉLANDE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais | | | |
| 2,000 % éch. 20/09/2025 NZD | 70 602 | 44 561 | 1,87 |
| 3,000 % éch. 20/09/2030 | 55 | 36 | 0,00 |
| Total Nouvelle-Zélande | 44 597 | 1,87 | |

PÉROU

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | |
| 5,940 % éch. 12/02/2029 PEN | 1 200 | 324 | 0,01 |

SLOVÉNIE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Nova Ljubljanska Banka d.d. | | | |
| 3,400 % éch. 05/02/2030 | € 1 100 | 1 055 | 0,04 |

ESPAGNE

TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Autonoria Spain | | | |
| 4,576 % éch. 30/09/2041 | 5 200 | 5 763 | 0,24 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| BBVA Consumer Auto | | | |
| 0,270 % éch. 20/07/2031 | € 325 | \$ 351 | 0,02 |
| | 6 114 | 0,26 | |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | |
| 0,500 % éch. 31/10/2031 | 200 | 186 | 0,01 |
| 0,600 % éch. 31/10/2029 | 24 400 | 24 053 | 1,01 |
| 0,700 % éch. 30/11/2033 (d) | 17 891 | 19 123 | 0,80 |
| 0,850 % éch. 30/07/2037 | 400 | 326 | 0,01 |
| 1,000 % éch. 30/11/2030 (d) | 2 797 | 3 121 | 0,13 |
| 3,150 % éch. 30/04/2033 | 228 | 256 | 0,01 |
| 3,550 % éch. 31/10/2033 | 160 | 185 | 0,01 |
| 3,900 % éch. 30/07/2039 | 500 | 585 | 0,03 |
| | 47 835 | 2,01 | |

Total Espagne 53 949 2,27

SUPRANATIONALES

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Union européenne | | | |
| 3,125 % éch. 05/12/2028 | 7 800 | 8 882 | 0,37 |

SUÈDE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Obligation internationale du gouvernement suédois | | | |
| 0,125 % éch. 01/06/2026 SEK | 117 724 | 11 447 | 0,48 |
| 0,125 % éch. 01/12/2027 | 17 102 | 1 657 | 0,07 |
| 0,125 % éch. 01/06/2032 | 58 430 | 5 624 | 0,24 |
| 1,000 % éch. 01/06/2025 | 131 355 | 12 945 | 0,54 |
| Total Suède | 31 673 | 1,33 | |

SUISSE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| UBS Group AG | | | |
| 2,125 % éch. 13/10/2026 | € 900 | 967 | 0,04 |
| 2,875 % éch. 02/04/2032 | 700 | 724 | 0,03 |
| 4,965 % éch. 16/01/2026 | 300 | 332 | 0,02 |
| 6,373 % éch. 15/07/2026 | \$ 750 | 759 | 0,03 |
| 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 1 000 | 1 274 | 0,05 |
| Total Suisse | 4 056 | 0,17 | |

ROYAUME-UNI

TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Alba PLC | | | |
| 5,509 % éch. 17/03/2039 | £ 1 779 | 2 200 | 0,09 |
| Atlas Funding PLC | | | |
| 6,120 % éch. 25/07/2058 | 4 489 | 5 726 | 0,24 |
| Avon Finance PLC | | | |
| 0,000 % éch. 28/12/2049 | 6 500 | 8 269 | 0,35 |
| Brants Bridge PLC | | | |
| 6,120 % éch. 14/06/2066 | 4 422 | 5 627 | 0,24 |
| Canada Square Funding PLC | | | |
| 6,070 % éch. 17/01/2059 | 8 007 | 10 148 | 0,43 |
| Canterbury Finance PLC | | | |
| 6,046 % éch. 16/05/2058 | 4 882 | 6 212 | 0,26 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Eurosail PLC | | | |
| 4,108 % éch. 13/03/2045 | € 937 | 1 028 | 0,04 |
| 4,219 % éch. 10/06/2044 | 937 | 1 031 | 0,04 |
| 4,219 % éch. 10/09/2044 | 1 438 | 1 579 | 0,07 |
| 5,489 % éch. 13/03/2045 | £ 1 304 | 1 651 | 0,07 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Friary PLC | | | |
| 0,000 % éch. 21/10/2071 | 2 200 | 2 814 | 0,12 |
| Great Hall Mortgages PLC | | | |
| 5,469 % éch. 18/03/2039 | 13 | 16 | 0,00 |
| 5,489 % éch. 18/06/2038 | 7 | 9 | 0,00 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| London Wall Mortgage Capital PLC | | | |
| 6,020 % éch. 15/05/2052 | 1 843 | 2 339 | 0,10 |
| Polaris PLC | | | |
| 5,985 % éch. 23/12/2058 | 3 223 | 4 100 | 0,17 |
| 5,995 % éch. 23/10/2059 | 8 232 | 10 444 | 0,44 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Precise Mortgage Funding PLC | | | |
| 6,420 % éch. 12/12/2055 | 2 282 | 2 911 | 0,12 |
| RMAC PLC | | | |
| 0,000 % éch. 15/02/2047 | 5 500 | 7 034 | 0,30 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Rochester Financing PLC | | | |
| 5,920 % éch. 18/12/2044 | £ 5 934 | \$ 7 509 | 0,32 |
| Stratton BTL Mortgage Funding PLC | | | |
| 5,951 % éch. 20/01/2054 | 3 573 | 4 541 | 0,19 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Stratton Mortgage Funding PLC | | | |
| 5,920 % éch. 12/12/2043 | 4 971 | 6 293 | 0,26 |
| 6,120 % éch. 12/03/2052 | 1 489 | 1 898 | 0,08 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Towd Point Mortgage Funding PLC | | | |
| 6,365 % éch. 20/10/2051 | 2 281 | 2 911 | 0,12 |
| 6,571 % éch. 20/07/2045 | 7 336 | 9 376 | 0,39 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Tower Bridge Funding PLC | | | |
| 0,000 % éch. 20/01/2066 (a) | 4 200 | 5 363 | 0,22 |
| 5,940 % éch. 20/12/2063 | 1 825 | 2 314 | 0,10 |
| 6,000 % éch. 20/11/2063 | 1 500 | 1 908 | 0,08 |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Twin Bridges PLC | | | |
| 5,880 % éch. 12/09/2055 | 4 942 | 6 248 | 0,26 |
| 6,470 % éch. 12/12/2054 | 4 952 | 6 322 | 0,27 |
| | 127 821 | 5,37 | |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Bon du Trésor britannique | | | |
| 0,125 % éch. 10/08/2028 (d) | 36 668 | 47 331 | 1,99 |
| 0,125 % éch. 10/08/2031 (d) | 20 075 | 25 972 | 1,09 |
| 0,125 % éch. 12/03/2039 (d) | 3 693 | 4 340 | 0,18 |
| 0,125 % éch. 10/08/2041 (d) | 16 213 | 18 591 | 0,78 |
| 0,125 % éch. 22/03/2044 (d) | 14 078 | 15 472 | 0,65 |
| 0,125 % éch. 22/03/2046 (d) | 7 181 | 7 680 | 0,32 |
| 0,125 % éch. 10/08/2048 (d) | 5 678 | 5 943 | 0,25 |
| 0,125 % éch. 22/03/2051 (d) | 13 219 | 13 440 | 0,56 |
| 0,125 % éch. 22/11/2056 (d) | 7 915 | 7 838 | 0,33 |
| 0,125 % éch. 22/03/2058 (d) | 14 558 | 14 155 | 0,59 |
| 0,125 % éch. 22/11/2065 (d) | 9 936 | 9 471 | 0,40 |
| 0,125 % éch. 22/03/2068 (d) | 14 072 | 13 410 | 0,56 |
| 0,125 % éch. 22/03/2073 (d) | 2 696 | 2 747 | 0,12 |
| 0,250 % éch. 22/03/2052 (d) | 20 303 | 21 315 | 0,90 |
| 0,375 % éch. 22/03/2062 (d) | 18 136 | 19 139 | 0,80 |
| 0,500 % éch. 22/03/2050 (d) | 11 827 | 13 436 | 0,56 |
| 0,500 % éch. 22/10/2061 | 6 200 | 2 664 | 0,11 |
| 0,625 % éch. 22/03/2040 (d) | 18 601 | 23 501 | 0,99 |
| 0,625 % éch. 22/11/2042 (d) | 15 025 | 18 624 | 0,78 |
| 0,625 % éch. 22/03/2045 (d) | 17 025 | 20 630 | 0,87 |
| 0,625 % éch. 22/10/2050 | 2 400 | 1 351 | 0,06 |
| 0,750 % éch. 22/03/2034 (d) | 25 380 | 34 022 | 1,43 |
| 0,750 % éch. 22/11/2047 (d) | 11 784 | 14 375 | 0,60 |
| 1,125 % éch. 22/11/2037 (d) | 22 231 | 30 741 | 1,29 |
| 1,250 % éch. 22/11/2027 (d) | 27 447 | 36 922 | 1,55 |
| 1,250 % éch. 22/11/2032 (d) | 40 395 | 56 982 | 2,39 |
| | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 2 878 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | \$ (2 936) | \$ 2 878 | \$ 2 879 | 0,12 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (2 936) | \$ 2 878 | \$ 2 879 | 0,12 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Court | 09/2025 | 868 | \$ (744) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois septembre | Long | 09/2026 | 868 | 589 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars | Court | 03/2024 | 205 | (149) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 43 | 98 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 766 | (1 500) | (0,06) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Court | 03/2024 | 216 | (807) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 632 | (3 033) | (0,13) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 5 | (8) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 413 | 1 695 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 4 611 | (2 987) | (0,13) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 57 | (56) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 2 117 | (4 471) | (0,19) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 608 | (2 159) | (0,09) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 4 | (23) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 4 | 37 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 176 | (2 081) | (0,09) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 437 | (2 387) | (0,10) |
| | | | | \$ (17 986) | (0,76) |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|-----------------|-------------------|------------------|----------|--------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor avril 2024 | € 96,750 | 12/04/2024 | 848 | \$ (573) | \$ (574) | (0,02) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | | \$ (18 560) | (0,78) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 % | 20/03/2029 | £ 2 000 | \$ (146) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 16/06/2029 | ¥ 5 177 000 | (25) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,237 | 21/11/2053 | \$ 27 000 | 5 253 | 0,22 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,340 | 21/11/2028 | 113 800 | (6 478) | (0,27) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,865 | 13/02/2054 | 26 100 | 1 512 | 0,06 |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,085 | 13/02/2034 | 82 600 | (1 798) | (0,08) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400 | 23/02/2033 | 5 300 | (88) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 16 700 | (178) | (0,01) |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 22/03/2026 | 53 800 | 90 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 133 100 | (1 193) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,868 | 22/12/2025 | 53 800 | (561) | (0,02) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 72 330 | (9 169) | (0,39) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 275 690 | 17 255 | 0,72 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2044 | 2 500 | (343) | (0,01) |
| À payer | CPTFEMU | 2,356 | 15/11/2033 | 8 200 | 201 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,359 | 15/08/2030 | 25 700 | 449 | 0,02 |
| À payer | CPTFEMU | 2,363 | 15/11/2033 | 4 500 | 107 | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,390 | 15/11/2033 | 4 700 | 121 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,470 | 15/07/2032 | 12 900 | 221 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,548 | 15/11/2053 | 1 400 | (45) | 0,00 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,600 | 15/05/2032 | 20 300 | 310 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,620 | 15/11/2053 | 3 000 | (182) | (0,01) |
| À payer | CPTFEMU | 2,680 | 15/04/2053 | 6 400 | 497 | 0,02 |
| À payer | CPTFEMU | 2,700 | 15/04/2053 | 8 500 | 787 | 0,03 |

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | CPTFEMU | 2,720 % | 15/06/2032 | € 63 300 | \$ (594) | (0,02) |
| À payer | CPTFEMU | 2,763 | 15/09/2053 | 6 900 | 703 | 0,03 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,975 | 15/08/2027 | 17 800 | (97) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 3,520 | 15/09/2024 | 23 800 | (134) | (0,01) |
| À payer | CPTFEMU | 3,720 | 15/09/2024 | 6 400 | 1 | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 1,760 | 04/11/2029 | \$ 23 300 | (3 506) | (0,15) |
| À payer | CPURNSA | 1,883 | 20/11/2029 | 300 | (42) | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 1,954 | 03/06/2029 | 6 200 | (819) | (0,03) |
| À payer | CPURNSA | 1,998 | 25/07/2029 | 1 800 | (226) | (0,01) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,311 | 24/02/2031 | 6 500 | 676 | 0,03 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,314 | 26/02/2026 | 14 400 | 1 423 | 0,06 |
| À payer | CPURNSA | 2,364 | 10/05/2028 | 800 | (67) | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 2,370 | 06/06/2028 | 12 900 | (1 096) | (0,05) |
| À payer | CPURNSA | 2,379 | 09/07/2028 | 700 | (58) | 0,00 |
| À payer | CPURNSA | 2,510 | 08/09/2024 | 9 500 | 9 | 0,00 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,573 | 26/08/2028 | 2 200 | 131 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,645 | 10/09/2028 | 3 600 | 186 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,690 | 01/06/2026 | 2 300 | 170 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,703 | 25/05/2026 | 8 980 | 666 | 0,03 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,768 | 13/05/2026 | 13 900 | 1 005 | 0,04 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,813 | 14/05/2026 | 20 100 | 1 404 | 0,06 |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,143 | 15/10/2032 | £ 7 800 | (206) | (0,01) |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,615 | 15/02/2027 | 12 300 | 467 | 0,02 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 5,200 | 15/06/2024 | 5 500 | 284 | 0,01 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 5,330 | 15/06/2024 | 11 900 | 574 | 0,02 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 6,290 | 15/03/2024 | 5 500 | 426 | 0,02 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 6,440 | 15/05/2024 | 2 200 | 136 | 0,01 |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 6,500 | 15/03/2024 | 26 700 | (1 914) | (0,08) |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 6,600 | 15/05/2024 | 5 400 | 309 | 0,01 |
| | | | | | \$ 6 408 | 0,27 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 6 408 | 0,27 |

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description | Indice initial | Taux variable | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 100,151 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035 | 7 800 | \$ (356) | \$ (286) | (0,01) |
| JPM | Taux plafond - CPURNSA hors cote | 233,916 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0 | 22/04/2024 | 37 600 | (273) | 0 | 0,00 |
| | Taux plafond - CPURNSA hors cote | 234,781 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0 | 16/05/2024 | 3 100 | (22) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | \$ (651) | \$ (286) | (0,01) |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,700 % | 13/02/2024 | 83 800 | \$ (366) | \$ (1 240) | (0,05) |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,950 | 15/09/2025 | 26 700 | (323) | (623) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,950 | 15/09/2025 | 26 700 | (323) | (146) | (0,01) |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,760 | 16/01/2024 | 80 300 | (373) | (1 133) | (0,05) |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,900 | 20/03/2024 | 96 900 | (467) | (540) | (0,02) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,465 | 04/12/2025 | 17 700 | (213) | (282) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,465 | 04/12/2025 | 17 700 | (213) | (151) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,900 | 29/08/2025 | 16 800 | (218) | (368) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,900 | 29/08/2025 | 16 800 | (218) | (84) | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,800 | 01/09/2025 | 36 200 | (458) | (738) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,800 | 01/09/2025 | 36 200 | (458) | (201) | (0,01) |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,758 | 16/01/2024 | 1 900 | (9) | (27) | 0,00 |
| | | | | | | \$ (3 639) | \$ (5 533) | (0,23) | |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 % | 17/10/2057 | \$ 12 175 | \$ (711) | \$ 718 | \$ 7 | 0,00 |
| SAL | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 2 500 | (5) | (4) | (9) | 0,00 |
| | | | | | \$ (716) | \$ 714 | \$ (2) | 0,00 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notional du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notional du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | | | | | | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|----|---------|-----|---------|----------|----|----------|--------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 23 435 | \$ | 15 524 | \$ | 0 | \$ | (470) | \$ | (470) | (0,02) | | | |
| BOA | 01/2024 | £ | 18 652 | | 23 607 | | 0 | | (172) | | (172) | (0,01) | | | |
| | 01/2024 | ¥ | 7 302 079 | | 49 482 | | 0 | | (2 345) | | (2 345) | (0,10) | | | |
| BPS | 01/2024 | \$ | 100 | MXN | 1 702 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 03/2024 | CNH | 130 795 | \$ | 18 194 | | 0 | | (280) | | (280) | (0,01) | | | |
| | 06/2024 | KRW | 11 793 745 | | 9 065 | | 0 | | (115) | | (115) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | DKK | 164 463 | | 24 259 | | 0 | | (119) | | (119) | (0,01) | | | |
| | 01/2024 | € | 714 922 | | 786 126 | | 0 | | (3 794) | | (3 794) | (0,16) | | | |
| | 01/2024 | HUF | 418 709 | | 1 192 | | 0 | | (18) | | (18) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | ¥ | 4 301 501 | | 29 351 | | 1 | | (1 181) | | (1 180) | (0,05) | | | |
| | 01/2024 | KRW | 197 067 | | 150 | | 0 | | (2) | | (2) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | SGD | 1 | | 1 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | \$ | 100 | BRL | 491 | | 1 | | 0 | | 1 | 0,00 | | | |
| BRC | 01/2024 | € | 1 499 | € | 1 370 | | 14 | | 0 | | 14 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | £ | 6 786 | £ | 5 378 | | 70 | | 0 | | 70 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 3 | HUF | 1 054 | | 0 | | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 350 | IDR | 5 413 713 | | 1 | | | 0 | | 1 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 8 357 | ZAR | 154 919 | | 103 | | | 0 | | 103 | 0,01 | | | |
| | 01/2024 | KRW | 387 690 | \$ | 300 | | 1 | | 0 | | 1 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | \$ | 3 133 | DKK | 21 175 | | 6 | | 0 | | 6 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 4 733 | MXN | 83 030 | | 149 | | | 0 | | 149 | 0,01 | | | |
| | 01/2024 | 298 | ZAR | 5 546 | | 5 | | | 0 | | 5 | 0,00 | | | |
| | 03/2024 | 4 997 | IDR | 77 691 593 | | 41 | | | 0 | | 41 | 0,00 | | | |
| CBK | 01/2024 | HUF | 114 515 | \$ | 327 | | 0 | | (4) | | (4) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | IDR | 4 628 561 | | 301 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | NZD | 68 936 | | 42 554 | | 0 | | (1 094) | | (1 094) | (0,04) | | | |
| | 01/2024 | \$ | 1 124 | £ | 888 | | 8 | | 0 | | 8 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 99 | MXN | 1 730 | | 3 | | | 0 | | 3 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | ZAR | 5 244 | \$ | 278 | | 0 | | (8) | | (8) | 0,00 | | | |
| | 03/2024 | PEN | 9 017 | | 2 395 | | 0 | | (35) | | (35) | 0,00 | | | |
| | 03/2024 | \$ | 301 | IDR | 4 629 749 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 06/2024 | 19 | KRW | 25 240 | | 0 | | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | KRW | 194 955 | \$ | 150 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| DUB GLM | 01/2024 | CAD | 76 029 | | 55 951 | | 0 | | (1 715) | | (1 715) | (0,07) | | | |
| | 01/2024 | DKK | 217 881 | | 32 140 | | 0 | | (156) | | (156) | (0,01) | | | |
| | 01/2024 | ¥ | 1 748 200 | | 11 923 | | 0 | | (485) | | (485) | (0,02) | | | |
| JPM | 01/2024 | ZAR | 2 849 | | 150 | | 0 | | (6) | | (6) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | DKK | 85 360 | | 12 552 | | 0 | | (97) | | (97) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | HUF | 1 265 609 | | 3 605 | | 0 | | (52) | | (52) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | \$ | 300 | IDR | 4 616 100 | | 0 | | (1) | | (1) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 150 | KRW | 194 424 | | 0 | | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| MBC | 02/2024 | 6 899 | BRL | 33 835 | | 55 | | | 0 | | 55 | 0,00 | | | |
| | 03/2024 | SGD | 21 | \$ | 16 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 06/2024 | KRW | 192 758 | | 150 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | AUD | 9 545 | | 6 329 | | 0 | | (185) | | (185) | (0,01) | | | |
| | 01/2024 | CAD | 3 360 | | 2 483 | | 0 | | (66) | | (66) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | DKK | 16 035 | | 2 321 | | 0 | | (56) | | (56) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | € | 38 147 | | 41 711 | | 0 | | (438) | | (438) | (0,02) | | | |
| | 01/2024 | £ | 353 | | 445 | | 0 | | (5) | | (5) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | HUF | 22 526 | | 64 | | 0 | | (1) | | (1) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | DKK | 14 530 | | 2 169 | | 15 | | 0 | | 15 | 0,00 | | | |
| MYI | 01/2024 | £ | 1 | | 1 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | ¥ | 2 773 807 | | 18 815 | | 0 | | (873) | | (873) | (0,04) | | | |
| | 01/2024 | \$ | 1 072 | DKK | 7 295 | | 10 | | 0 | | 10 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 1 059 | € | 956 | | 0 | | | (4) | | (4) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 2 510 | £ | 1 986 | | 23 | | | (2) | | (2) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 102 | ZAR | 1 865 | | 0 | | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| | 03/2024 | 299 | IDR | 4 648 950 | | 2 | | | 0 | | 2 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | 1 195 | £ | 934 | | 0 | | | (4) | | (4) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | £ | 519 188 | \$ | 656 710 | | 0 | | (5 171) | | (5 171) | (0,22) | | | |
| | 01/2024 | SGD | 9 | | 7 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 | | | |
| RYL | 01/2024 | \$ | 2 569 | MXN | 45 110 | | 83 | | 0 | | 83 | 0,00 | | | |
| | 03/2024 | TWD | 427 105 | \$ | 13 732 | | 0 | | (421) | | (421) | (0,02) | | | |
| | 03/2024 | \$ | 4 593 | INR | 384 167 | | 8 | | 0 | | 8 | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | AUD | 7 716 | \$ | 5 120 | | 0 | | (147) | | (147) | (0,01) | | | |
| | 01/2024 | ¥ | 292 230 | | 1 995 | | 0 | | (79) | | (79) | 0,00 | | | |
| | 01/2024 | SEK | 293 658 | | 28 453 | | 0 | | (693) | | (693) | (0,03) | | | |
| | 01/2024 | \$ | 385 | MXN | 6 766 | | 13 | | 0 | | 13 | 0,00 | | | |
| | 03/2024 | 4 367 | INR | 365 422 | | 9 | | | 0 | | 9 | 0,00 | | | |
| | | | | | | | | | \$ | 621 | \$ | (20 294) | \$ | (19 673) | (0,83) |

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution et Investisseurs en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | \$ 362 | CHF 309 | \$ 5 | \$ 0 | \$ 5 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | \$ 3 380 | \$ 2 948 | \$ 125 | \$ 0 | \$ 125 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | CHF 105 | \$ 121 | \$ 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 27 382 | CHF 23 857 | 977 | 0 | 977 | 0,04 |
| GLM | 01/2024 | CHF 321 | \$ 368 | \$ 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 30 456 | CHF 26 687 | 1 269 | 0 | 1 269 | 0,05 |
| MYI | 01/2024 | CHF 252 | \$ 289 | \$ 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 29 926 | CHF 26 123 | 1 128 | 0 | 1 128 | 0,05 |
| SCX | 01/2024 | CHF 19 | \$ 22 | \$ 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 3 504 | \$ (29) | \$ 3 475 | 0,15 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 457 | AUD 691 | \$ 15 | \$ 0 | \$ 15 | 0,00 |
| | 01/2024 | 902 | £ 712 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 581 | ¥ 85 664 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 01/2024 | 251 | NZD 412 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 29 | DKK 196 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 414 | £ 1 115 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | 365 | ¥ 53 664 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | DKK 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 | SEK 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 777 | CAD 1 056 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | CAD 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 50 | AUD 75 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 9 281 | € 8 441 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 221 | ¥ 32 541 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 290 | SEK 3 017 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 38 | DKK 260 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 7 666 | £ 6 058 | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| | | | | \$ 228 | \$ 0 | \$ 228 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 10 195 | \$ 11 143 | \$ 2 | \$ (123) | \$ (121) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 399 605 | € 363 351 | 1 862 | 0 | 1 862 | 0,08 |
| BRC | 01/2024 | 355 686 | 323 415 | 1 657 | 0 | 1 657 | 0,07 |
| CBK | 01/2024 | € 8 224 | \$ 8 944 | 1 | (144) | (143) | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | 2 876 | 3 123 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 319 539 | € 292 235 | 3 353 | 0 | 3 353 | 0,14 |
| UAG | 01/2024 | 2 499 | 2 272 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | | | | \$ 6 886 | \$ (321) | \$ 6 565 | 0,27 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et R en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 183 | \$ 231 | \$ 0 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 14 232 | £ 11 230 | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 127 | \$ 160 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 16 619 | £ 13 102 | 84 | 0 | 84 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 291 | 230 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 1 967 | \$ 2 487 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 17 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 2 100 | 2 668 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 488 | 623 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | \$ 95 786 | £ 75 727 | 754 | 0 | 754 | 0,03 |
| SSB | 01/2024 | £ 230 | \$ 289 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 63 045 | £ 49 962 | 649 | 0 | 649 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | £ 1 500 | \$ 1 877 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 95 780 | £ 75 681 | 702 | 0 | 702 | 0,03 |
| | | | | \$ 2 277 | \$ (73) | \$ 2 204 | 0,09 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| DUB | 01/2024 | \$ 58 525 | SGD 77 798 | \$ 470 | \$ 0 | \$ 470 | 0,02 |
| JPM | 01/2024 | 12 438 | 16 589 | 141 | 0 | 141 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 54 569 | 72 791 | 629 | 0 | 629 | 0,03 |
| TOR | 01/2024 | 52 083 | 69 493 | 613 | 0 | 613 | 0,02 |
| | | | | \$ 1 853 | \$ 0 | \$ 1 853 | 0,08 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ (11 169) | (0,47) |
| Total des Investissements | | | | | | \$ 3 703 023 | 155,52 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | \$ (1 321 930) | (55,52) |
| Actifs nets | | | | | | \$ 2 381 093 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 1 193 907 \$ (31 décembre 2022 : 734 559 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 9 544 \$) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 4 789 \$ (31 décembre 2022 : 101 \$) et un montant en numéraire de 3 304 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 32 998 \$ (31 décembre 2022 : 24 192 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 20 690 \$ (31 décembre 2022 : 21 490 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 3 694 700 | \$ 5 369 | \$ 3 700 069 |
| Fonds d'investissement | 23 397 | 0 | 0 | 23 397 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 2 878 | 0 | 2 878 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (9 807) | (13 514) | 0 | (23 321) |
| Totaux | \$ 13 590 | \$ 3 684 064 | \$ 5 369 | \$ 3 703 023 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 3 391 396 | \$ 0 | \$ 3 391 396 |
| Fonds d'investissement | 7 043 | 0 | 0 | 7 043 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 2 245 | 0 | 2 245 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (4 808) | 18 214 | 0 | 13 406 |
| Totaux | \$ 2 235 | \$ 3 411 855 | \$ 0 | \$ 3 414 090 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| CIB | 5,470 % | 21/11/2023 | 04/01/2024 | \$ (157 548) | \$ (158 529) | (6,66) |
| | 5,470 | 13/12/2023 | 04/01/2024 | (34 825) | (34 926) | (1,47) |
| NOM | 5,500 | 07/12/2023 | 18/01/2024 | (377 351) | (378 792) | (15,91) |
| SCX | 3,920 | 01/11/2023 | 07/02/2024 | € (63 384) | (70 474) | (2,96) |
| STR | 5,540 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | \$ (435 389) | (435 389) | (18,28) |
| | 5,660 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | (478 632) | (478 858) | (20,11) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (1 556 968) | (65,39) |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (470) | \$ 350 | \$ (120) | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | (2 771) | 2 700 | (71) | 3 056 | (2 990) | 66 |
| BOM | S/O | S/O | S/O | 110 | 0 | 110 |
| BPS | (4 313) | 6 400 | 2 087 | (381) | 580 | 199 |
| BRC | 1 986 | (3 850) | (1 864) | (156) | 130 | (26) |
| CBK | (1 090) | 660 | (430) | 11 029 | (10 872) | 157 |
| DUB | 470 | (350) | 120 | (3 859) | 3 720 | (139) |
| FAR | (1 133) | 1 000 | (133) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | (2 794) | 2 320 | (474) | (1 194) | 610 | (584) |
| GST | (932) | 900 | (32) | (2 425) | 2 410 | (15) |
| JPM | 46 | 0 | 46 | (2 608) | 2 180 | (428) |
| MBC | 2 587 | (4 050) | (1 463) | 8 954 | (8 240) | 714 |
| MYC | (27) | 0 | (27) | (36) | 90 | 54 |
| MYI | 928 | (1 200) | (272) | (3 890) | 2 910 | (980) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | 44 | 0 | 44 |
| RYL | (4) | 0 | (4) | S/O | S/O | S/O |
| SAL | (9) | 130 | 121 | (20) | 130 | 110 |
| SCX | (4 738) | 5 720 | 982 | (7 751) | 7 310 | (441) |
| SSB | 645 | (560) | 85 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 613 | (440) | 173 | (270) | 1 420 | 1 150 |
| UAG | (163) | 510 | 347 | 18 | 0 | 18 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 131,53 | 115,82 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 23,61 | 15,81 |
| Autres valeurs mobilières | 0,26 | 0,25 |
| Fonds d'investissement | 0,98 | 0,27 |
| Contrats de mise en pension | 0,12 | 0,09 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,78) | (0,09) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,27 | 0,58 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,47) | 0,02 |
| Contrats de prise en pension | (65,39) | (30,96) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | S/O | (0,37) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Australie | 1,22 | 1,83 |
| Belgique | 0,08 | 0,07 |
| Canada | 1,61 | 1,46 |
| Îles Caïmans | 1,09 | 1,58 |
| Danemark | 2,92 | 4,20 |
| France | 9,43 | 7,82 |
| Allemagne | 3,63 | 0,86 |
| Irlande | 9,23 | 8,54 |
| Italie | 12,38 | 7,79 |
| Japon | 5,12 | 4,27 |
| Luxembourg | 0,87 | 0,02 |
| Pays-Bas | 0,75 | 0,71 |
| Nouvelle-Zélande | 1,87 | 1,63 |
| Pérou | 0,01 | 0,07 |
| Slovénie | 0,04 | 0,04 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Espagne | 2,27 | 1,71 |
| Supranationales | 0,37 | S/O |
| Suède | 1,33 | 1,15 |
| Suisse | 0,17 | S/O |
| Royaume-Uni | 28,51 | 25,93 |
| États-Unis | 71,99 | 62,20 |
| Instruments à court terme | 0,51 | S/O |
| Fonds d'investissement | 0,98 | 0,27 |
| Contrats de mise en pension | 0,12 | 0,09 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,76) | (0,09) |
| Options vendues | | |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | (0,02) | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,27 | 0,58 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,46 |
| Options vendues | | |
| Options plafonnées sur l'inflation | (0,01) | (0,02) |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,23) | (0,88) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,83) | (0,96) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,60 | 1,42 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (55,52) | (32,75) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | BNP Paribas Issuance BV | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | BANQUE ET FINANCE | | | | 0,000 % éch. 09/04/2029 \$ 10 \$ 1 652 088 2,34 | | | |
| American Airlines, Inc. 10,427 % éch. 20/04/2028 | \$ 58 950 | \$ 60 649 | 0,09 | ABN AMRO Bank NV 6,575 % éch. 13/10/2026 | \$ 99 500 | \$ 101 192 | 0,14 | BPC S.A. 1,652 % éch. 06/10/2026 | 1 027 | 956 | 0,00 |
| Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,708 % éch. 22/06/2028 | 4 102 | 4 111 | 0,01 | Adler Financing SARL (12,500 % en numéraire ou 12,500 % de rémunération en nature) 12,500 % éch. 30/06/2025 (d) | € 903 | 1 053 | 0,00 | 6,612 % éch. 19/10/2027 | 207 300 | 213 498 | 0,30 |
| Carnival Corp. 7,593 % éch. 30/06/2025 | € 60 916 | 67 501 | 0,10 | AGFC Capital Trust 7,405 % éch. 15/01/2067 | \$ 23 000 | 11 697 | 0,02 | 6,714 % éch. 19/10/2029 | 188 100 | 198 264 | 0,28 |
| 8,720 % éch. 18/10/2028 | \$ 15 234 | 15 278 | 0,02 | AGPS BondCo PLC 5,000 % éch. 27/04/2027 | € 1 100 | 409 | 0,00 | 7,003 % éch. 19/10/2034 | 152 500 | 165 924 | 0,24 |
| Cengage Learning, Inc. 10,405 % éch. 14/07/2026 | 28 669 | 28 796 | 0,04 | 5,500 % éch. 13/11/2026 | 200 | 78 | 0,00 | Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % éch. 15/11/2027 | 7 918 | 7 083 | 0,01 |
| Charter Communications Operating LLC 7,133 % éch. 01/02/2027 | 34 569 | 34 613 | 0,05 | AIB Group PLC 5,250 % éch. 23/10/2031 | 92 600 | 110 677 | 0,16 | 7,800 % éch. 15/03/2028 | 3 832 | 3 880 | 0,01 |
| Diamond Sports Group LLC TBD % - 15,420 % éch. 25/05/2026 | 4 030 | 3 053 | 0,00 | 6,608 % éch. 13/09/2029 | \$ 20 300 | 21 408 | 0,03 | CaixaBank S.A. 6,208 % éch. 18/01/2029 | 64 050 | 65 389 | 0,09 |
| DirecTV Financing LLC 10,650 % éch. 02/08/2027 | 35 427 | 35 491 | 0,05 | Ally Financial, Inc. 5,800 % éch. 01/05/2025 | 20 282 | 20 317 | 0,03 | 6,684 % éch. 13/09/2027 | 21 400 | 21 952 | 0,03 |
| Emerald TopCo, Inc. 8,970 % éch. 24/07/2026 | 3 548 | 3 523 | 0,01 | Ambac Assurance Corp. 5,100 % (i) | 0 | 0 | 0,00 | 6,840 % éch. 13/09/2034 | 21 000 | 22 197 | 0,03 |
| Envision Healthcare Corp. 13,258 % éch. 15/09/2028 | 58 953 | 58 953 | 0,08 | American Assets Trust LP 3,375 % éch. 01/02/2031 | 4 800 | 3 918 | 0,01 | CIFI Holdings Group Co. Ltd. 4,375 % éch. 12/04/2027 ^ | 2 000 | 117 | 0,00 |
| Finastra USA, Inc. 0,500 % - 12,616 % éch. 13/09/2029 µ | 2 979 | 2 978 | 0,00 | American Tower Corp. 3,650 % éch. 15/03/2027 | 6 200 | 5 967 | 0,01 | 4,450 % éch. 17/08/2026 ^ | 1 700 | 117 | 0,00 |
| 12,713 % éch. 13/09/2029 | 28 721 | 28 683 | 0,04 | Armor Holdco, Inc. 8,500 % éch. 15/11/2029 | 800 | 726 | 0,00 | 4,800 % éch. 17/05/2028 ^ | 700 | 50 | 0,00 |
| iHeartCommunications, Inc. 8,470 % éch. 01/05/2026 | 256 394 | 222 277 | 0,32 | Army Hawaii Family Housing Trust Certificates 5,876 % éch. 15/06/2050 | 102 010 | 71 550 | 0,10 | 5,250 % éch. 13/05/2026 ^ | 1 100 | 65 | 0,00 |
| 8,720 % éch. 01/05/2026 | 10 691 | 9 220 | 0,01 | Aroundtown S.A. 1,500 % éch. 28/05/2026 | € 300 | 297 | 0,00 | 5,950 % éch. 20/10/2025 ^ | 1 300 | 91 | 0,00 |
| Laaland Finance Co. BV 8,470 % éch. 28/06/2024 | 2 771 | 1 926 | 0,00 | 5,375 % éch. 21/03/2029 | \$ 33 840 | 27 896 | 0,04 | 6,000 % éch. 16/07/2025 ^ | 2 000 | 135 | 0,00 |
| Laaland Finance Co. BV (6,470 % en numéraire et 3,000 % de rémunération en nature) | | | | Banque de développement asiatique 4,700 % éch. 12/03/2024 MXN | 99 000 | 5 765 | 0,01 | 6,450 % éch. 07/11/2024 ^ | 3 300 | 235 | 0,00 |
| 3,000 % - 6,470 % éch. 30/06/2025 (d) | 6 706 | 2 806 | 0,00 | Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027 | \$ 165 597 | 146 862 | 0,21 | Citigroup, Inc. 2,572 % éch. 03/06/2031 (l) | 5 000 | 4 274 | 0,01 |
| Poseidon Bidco SASU 9,175 % éch. 30/09/2028 | € 103 800 | 114 806 | 0,16 | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % éch. 09/01/2026 | € 33 400 | 35 094 | 0,05 | 3,106 % éch. 08/04/2026 | 1 800 | 1 750 | 0,00 |
| PUG LLC 8,970 % éch. 12/02/2027 | \$ 13 051 | 12 875 | 0,02 | 2,625 % éch. 28/04/2025 | 5 400 | 5 823 | 0,01 | Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % en numéraire ou 11,000 % de rémunération en nature) | € 1 000 | 1 105 | 0,00 |
| 9,720 % éch. 12/02/2027 | 973 | 968 | 0,00 | 3,625 % éch. 24/09/2024 | 4 800 | 5 268 | 0,01 | 10,000 % éch. 31/12/2026 (d) | € 1 000 | 1 105 | 0,00 |
| SCUR-Alpha 1503 GmbH 9,448 % éch. 29/03/2030 | € 62 100 | 63 013 | 0,09 | 6,750 % éch. 02/03/2026 | 129 460 | 146 449 | 0,21 | Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) | € 9 000 | | |
| 10,883 % éch. 29/03/2030 | \$ 112 849 | 104 151 | 0,15 | 7,708 % éch. 18/01/2028 | 5 000 | 5 537 | 0,01 | 8,000 % éch. 31/12/2026 ^ (d) | 6 482 | 3 750 | 0,01 |
| Sotera Health Holdings LLC 8,395 % éch. 11/12/2026 | 17 409 | 17 423 | 0,02 | 8,000 % éch. 22/01/2030 | 26 444 | 29 467 | 0,04 | Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % éch. 12/07/2026 ^ | \$ 8 400 | 646 | 0,00 |
| SS&C European Holdings SARL 7,220 % éch. 16/04/2025 | 8 319 | 8 341 | 0,01 | 8,500 % éch. 10/09/2030 | 12 200 | 13 584 | 0,02 | 3,125 % éch. 22/10/2025 ^ | 13 400 | 1 167 | 0,00 |
| SS&C Technologies, Inc. 7,220 % éch. 16/04/2025 | 14 149 | 14 184 | 0,02 | Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % éch. 17/09/2024 | PEN 95 500 | 25 051 | 0,04 | 3,875 % éch. 22/10/2030 ^ | 6 400 | 503 | 0,00 |
| Syniverse Holdings, Inc. 12,348 % éch. 13/05/2027 | 39 299 | 34 755 | 0,05 | Banco Espirito Santo S.A. 2,625 % éch. 08/05/2017 ^ | € 16 200 | 4 921 | 0,01 | 4,800 % éch. 06/08/2030 ^ | 1 000 | 84 | 0,00 |
| TransDigm, Inc. 8,598 % éch. 22/02/2027 | 36 573 | 36 772 | 0,05 | 4,750 % éch. 15/01/2018 ^ | 8 100 | 2 461 | 0,00 | 5,125 % éch. 17/01/2025 ^ | 1 600 | 125 | 0,00 |
| 8,598 % éch. 24/08/2028 | 83 172 | 83 655 | 0,12 | Banco Santander S.A. 1,849 % éch. 25/03/2026 | \$ 5 000 | 4 631 | 0,01 | 5,400 % éch. 27/05/2025 ^ | 1 600 | 133 | 0,00 |
| U.S. Renal Care, Inc. 10,470 % éch. 20/06/2028 | 24 981 | 19 048 | 0,03 | 4,250 % éch. 11/04/2027 | 2 800 | 2 715 | 0,00 | 5,625 % éch. 14/01/2030 ^ | 700 | 57 | 0,00 |
| United Airlines, Inc. 9,220 % éch. 21/04/2028 | 18 607 | 18 700 | 0,03 | 4,379 % éch. 12/04/2028 | 1 200 | 1 167 | 0,00 | 6,150 % éch. 17/09/2025 ^ | 1 000 | 84 | 0,00 |
| Veritas U.S., Inc. 10,470 % éch. 01/09/2025 | 1 976 | 1 649 | 0,00 | 6,527 % éch. 07/11/2027 | 47 800 | 49 460 | 0,07 | 6,500 % éch. 08/04/2024 ^ | 500 | 44 | 0,00 |
| Wesco Aircraft Holdings, Inc. TBD % - 13,988 % éch. 01/03/2024 | 7 371 | 7 821 | 0,01 | 6,607 % éch. 07/11/2028 | 30 800 | 32 818 | 0,05 | 8,000 % éch. 27/01/2024 ^ | 2 800 | 224 | 0,00 |
| Westmoreland Coal Co. 8,000 % éch. 04/11/2030 | 1 962 | 1 452 | 0,00 | Bank of America Corp. 3,419 % éch. 20/12/2028 | 19 850 | 18 711 | 0,03 | CPI Property Group S.A. 1,500 % éch. 27/01/2031 | € 2 200 | 1 286 | 0,00 |
| Windstream Services LLC 11,706 % éch. 21/09/2027 | 27 107 | 25 718 | 0,04 | 3,824 % éch. 20/01/2028 | 2 692 | 2 588 | 0,00 | 2,750 % éch. 12/05/2026 | 2 600 | 2 405 | 0,00 |
| Wm Morrison Supermarkets Ltd. 8,752 % éch. 04/11/2027 | € 112 376 | 118 220 | 0,17 | 4,571 % éch. 27/04/2033 | 3 000 | 2 861 | 0,00 | 2,750 % éch. 22/01/2028 | € 1 700 | 1 527 | 0,00 |
| Worldpay LLC TBD % éch. 31/01/2031 | \$ 25 200 | 25 342 | 0,04 | 4,827 % éch. 22/07/2026 | 3 300 | 3 276 | 0,00 | Crédit Agricole S.A. 6,316 % éch. 03/10/2029 | \$ 23 650 | 24 794 | 0,04 |
| | | 1 288 751 | 1,83 | 5,202 % éch. 25/04/2029 | 7 300 | 7 350 | 0,01 | Credit Suisse AG 0,495 % éch. 02/02/2024 | 17 400 | 17 324 | 0,02 |
| | | | | 5,288 % éch. 25/04/2034 | 51 100 | 51 245 | 0,07 | 5,500 % éch. 20/08/2026 | € 78 600 | 91 319 | 0,13 |
| | | | | Bank of Nova Scotia 4,900 % éch. 04/06/2025 (i)(k) | 3 346 | 3 204 | 0,00 | Credit Suisse AG AT1 Claim | \$ 138 872 | 16 664 | 0,02 |
| | | | | Barclays PLC 4,972 % éch. 16/05/2029 | 81 215 | 79 804 | 0,11 | Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 17/02/2032 | € 39 900 | 36 284 | 0,05 |
| | | | | 5,501 % éch. 09/08/2028 | 40 884 | 41 095 | 0,06 | 1,750 % éch. 19/11/2030 | 5 000 | 4 809 | 0,01 |
| | | | | 6,490 % éch. 13/09/2029 | 13 300 | 13 860 | 0,02 | 2,129 % éch. 24/11/2026 (l) | \$ 24 300 | 22 792 | 0,03 |
| | | | | 6,496 % éch. 13/09/2027 | 31 300 | 32 191 | 0,05 | 3,035 % éch. 28/05/2032 (l) | 45 920 | 38 388 | 0,05 |
| | | | | 6,692 % éch. 13/09/2024 | 26 900 | 28 777 | 0,04 | 3,547 % éch. 18/09/2031 | 20 300 | 17 827 | 0,03 |
| | | | | 7,385 % éch. 02/11/2028 | 21 400 | 22 883 | 0,03 | 6,720 % éch. 18/01/2029 | 34 800 | 36 463 | 0,05 |
| | | | | 7,437 % éch. 02/11/2033 | 35 850 | 40 169 | 0,06 | 6,819 % éch. 20/11/2029 | 26 700 | 28 128 | 0,04 |
| | | | | Bevco Lux SARL 1,000 % éch. 16/01/2030 | € 15 000 | 13 904 | 0,02 | East Lane Re Ltd. 14,582 % éch. 31/03/2026 | 14 900 | 14 974 | 0,02 |
| | | | | Blue Ridge Re Ltd. 10,582 % éch. 08/01/2031 | \$ 11 486 | 11 492 | 0,02 | EPR Properties 3,600 % éch. 15/11/2031 | 841 | 698 | 0,00 |
| | | | | | | | | 3,750 % éch. 15/08/2029 | 2 887 | 2 543 | 0,00 |
| | | | | | | | | 4,500 % éch. 01/06/2027 | 5 100 | 4 816 | 0,01 |
| | | | | | | | | 4,750 % éch. 15/12/2026 | 7 623 | 7 300 | 0,01 |
| | | | | | | | | 4,950 % éch. 15/04/2028 | 7 610 | 7 226 | 0,01 |
| | | | | | | | | Equinix, Inc. 2,900 % éch. 18/11/2026 | 2 400 | 2 281 | 0,00 |
| | | | | | | | | Erste Group Bank AG 4,250 % éch. 15/10/2027 (i)(k) | € 29 000 | 27 518 | 0,04 |
| | | | | | | | | Essential Properties LP 2,950 % éch. 15/07/2031 | \$ 4 000 | 3 150 | 0,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Extra Space Storage LP | | | | Morgan Stanley | | | | SLM Student Loan Trust | | | |
| 5,900 % éch. 15/01/2031 | \$ 12 500 | \$ 13 055 | 0,02 | 0,000 % éch. 02/04/2032 (l) | \$ 68 500 | \$ 41 638 | 0,06 | 4,475 % éch. 15/12/2033 | € 10 742 | \$ 11 018 | 0,02 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | | | | 2,188 % éch. 28/04/2026 | 1 400 | 1 345 | 0,00 | Société Générale S.A. | | | |
| 2,748 % éch. 14/06/2024 | £ 17 601 | 22 139 | 0,03 | 3,622 % éch. 01/04/2031 | 13 200 | 12 165 | 0,02 | 2,889 % éch. 09/06/2032 | \$ 14 300 | 11 812 | 0,02 |
| 7,200 % éch. 10/06/2030 | \$ 3 200 | 3 412 | 0,00 | 4,679 % éch. 17/07/2026 | 2 400 | 2 378 | 0,00 | 6,446 % éch. 10/01/2029 | 51 300 | 53 112 | 0,08 |
| 7,350 % éch. 04/11/2027 | 2 800 | 2 955 | 0,00 | 5,123 % éch. 01/02/2029 | 4 237 | 4 259 | 0,01 | 6,447 % éch. 12/01/2027 | 42 900 | 43 674 | 0,06 |
| Gateway Casinos & Entertainment Ltd. | | | | 6,138 % éch. 16/10/2026 | 2 000 | 2 037 | 0,00 | 6,691 % éch. 10/01/2034 | 137 100 | 144 927 | 0,21 |
| 5,000 % éch. 12/03/2038 CAD | 46 366 | 32 032 | 0,05 | National Health Investors, Inc. | | | | Standard Chartered PLC | | | |
| GLP Capital LP | | | | 3,000 % éch. 01/02/2031 | 9 000 | 7 207 | 0,01 | 2,678 % éch. 29/06/2032 | 3 500 | 2 849 | 0,00 |
| 3,250 % éch. 15/01/2032 | \$ 4 100 | 3 466 | 0,01 | Nationwide Building Society | | | | 6,170 % éch. 09/01/2027 | 5 500 | 5 586 | 0,01 |
| 4,000 % éch. 15/01/2031 | 17 715 | 15 974 | 0,02 | 3,960 % éch. 18/07/2030 | 163 883 | 153 224 | 0,22 | 6,750 % éch. 08/02/2028 | 154 900 | 159 680 | 0,23 |
| 5,250 % éch. 01/06/2025 | 3 502 | 3 492 | 0,01 | 4,302 % éch. 08/03/2029 | 34 100 | 32 699 | 0,05 | 7,018 % éch. 08/02/2030 | 4 800 | 5 071 | 0,01 |
| 5,300 % éch. 15/01/2029 | 16 214 | 16 130 | 0,02 | 4,500 % éch. 01/11/2026 | € 73 400 | 83 677 | 0,12 | Stichting AK Rabobank Certificaten | | | |
| 6,750 % éch. 01/12/2033 | 1 900 | 2 052 | 0,00 | 6,557 % éch. 18/10/2027 | \$ 97 120 | 100 596 | 0,14 | 6,500 % (i) | € 206 326 | 228 841 | 0,32 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | | Nature Coast Re Ltd. | | | | Sunac China Holdings Ltd. | | | |
| 3,750 % éch. 25/02/2026 | 5 700 | 5 571 | 0,01 | 10,000 % éch. 07/12/2030 | 11 206 | 11 211 | 0,02 | 6,000 % éch. 30/09/2026 | \$ 337 | 35 | 0,00 |
| 4,223 % éch. 01/05/2029 | 7 100 | 6 873 | 0,01 | NatWest Group PLC | | | | 6,250 % éch. 30/09/2027 | 337 | 27 | 0,00 |
| 6,484 % éch. 24/10/2029 | 150 000 | 159 265 | 0,23 | 4,445 % éch. 08/05/2030 | 121 125 | 116 168 | 0,16 | 6,500 % éch. 30/09/2027 | 675 | 53 | 0,00 |
| Goodman U.S. Finance Three LLC | | | | 4,892 % éch. 18/05/2029 | 62 833 | 61 762 | 0,09 | 6,750 % éch. 30/09/2028 | 1 012 | 46 | 0,00 |
| 3,700 % éch. 15/03/2028 | 11 640 | 10 845 | 0,02 | 5,076 % éch. 27/01/2030 | 134 670 | 132 721 | 0,19 | 7,000 % éch. 30/09/2029 | 1 012 | 55 | 0,00 |
| Hexagon RE Ltd. | | | | 6,016 % éch. 02/03/2034 | 62 800 | 66 003 | 0,09 | 7,250 % éch. 30/09/2030 | 476 | 19 | 0,00 |
| 13,871 % éch. 07/01/2031 | € 10 684 | 11 770 | 0,02 | Navient Corp. | | | | SVB Financial Group | | | |
| Highwoods Realty LP | | | | 5,625 % éch. 25/01/2025 | 3 549 | 3 338 | 0,00 | 3,125 % éch. 05/06/2030 ^ | 300 | 197 | 0,00 |
| 3,050 % éch. 15/02/2030 | \$ 1 100 | 910 | 0,00 | New Metro Global Ltd. | | | | Taranis Reinsurance DAC | | | |
| HSBC Holdings PLC | | | | 4,500 % éch. 02/05/2026 | 4 600 | 1 162 | 0,00 | 9,958 % éch. 07/01/2031 | € 6 700 | 7 407 | 0,01 |
| 2,357 % éch. 18/08/2031 | 46 700 | 38 715 | 0,06 | 4,625 % éch. 15/10/2025 | 800 | 230 | 0,00 | 12,155 % éch. 08/01/2031 | 9 400 | 10 391 | 0,01 |
| 2,804 % éch. 24/05/2032 | 25 700 | 21 466 | 0,03 | 4,800 % éch. 15/12/2024 | 7 900 | 3 140 | 0,00 | U.S. Capital Funding Ltd. | | | |
| 2,848 % éch. 04/06/2031 | 3 600 | 3 099 | 0,00 | Nissan Motor Acceptance Co. LLC | | | | 5,948 % éch. 10/07/2043 | \$ 5 010 | 3 857 | 0,01 |
| 3,973 % éch. 22/05/2030 | 46 600 | 43 567 | 0,06 | 2,750 % éch. 09/03/2028 | 21 400 | 18 899 | 0,03 | 6,389 % éch. 01/08/2034 | 400 | 398 | 0,00 |
| 4,583 % éch. 19/06/2029 | 15 300 | 14 848 | 0,02 | Nomura Holdings, Inc. | | | | UBS AG | | | |
| 5,402 % éch. 11/08/2033 | 7 000 | 7 034 | 0,01 | 2,172 % éch. 14/07/2028 | 14 968 | 13 160 | 0,02 | 5,125 % éch. 15/05/2024 (k) | 49 785 | 49 436 | 0,07 |
| 5,887 % éch. 14/08/2027 | 54 600 | 55 381 | 0,08 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab | | | | UBS Group AG | | | |
| 6,254 % éch. 09/03/2034 | 126 700 | 134 731 | 0,19 | 2,000 % éch. 01/10/2047 DKK | 0 | 0 | 0,00 | 2,746 % éch. 11/02/2033 | 3 116 | 2 558 | 0,00 |
| Hudson Pacific Properties LP | | | | Nykredit Realkredit A/S | | | | 3,091 % éch. 14/05/2032 | 57 350 | 48 871 | 0,07 |
| 3,250 % éch. 15/01/2030 | 500 | 368 | 0,00 | 2,000 % éch. 01/07/2037 | 0 | 0 | 0,00 | 3,126 % éch. 13/08/2030 | 19 222 | 17 167 | 0,02 |
| 3,950 % éch. 01/11/2027 | 4 445 | 3 726 | 0,01 | 2,000 % éch. 01/10/2047 | 0 | 0 | 0,00 | 3,750 % éch. 26/03/2025 | 20 900 | 20 493 | 0,03 |
| 4,650 % éch. 01/04/2029 | 4 517 | 3 670 | 0,01 | Orange Capital RE DAC | | | | 3,869 % éch. 12/01/2029 | 5 750 | 5 426 | 0,01 |
| 5,950 % éch. 15/02/2028 | 14 077 | 12 459 | 0,02 | 11,475 % éch. 08/01/2027 | € 9 900 | 10 942 | 0,02 | 4,194 % éch. 01/04/2031 | 83 637 | 77 949 | 0,11 |
| InCaps Funding Ltd. | | | | Park Aerospace Holdings Ltd. | | | | 5,959 % éch. 12/01/2034 | 93 281 | 96 514 | 0,14 |
| 7,639 % éch. 01/06/2033 | 1 998 | 1 878 | 0,00 | 5,500 % éch. 15/02/2024 | \$ 13 831 | 13 806 | 0,02 | 6,246 % éch. 22/09/2029 | 29 700 | 31 005 | 0,04 |
| Intesa Sanpaolo SpA | | | | Preferred Term Securities Ltd. | | | | 6,301 % éch. 22/09/2034 | 10 000 | 10 594 | 0,02 |
| 7,200 % éch. 28/11/2033 | 37 900 | 40 429 | 0,06 | 5,735 % éch. 22/03/2038 | 9 159 | 8 472 | 0,01 | 6,327 % éch. 22/12/2027 | 30 800 | 31 760 | 0,05 |
| 7,800 % éch. 28/11/2053 | 25 000 | 27 473 | 0,04 | 5,785 % éch. 22/03/2038 | 7 962 | 6 609 | 0,01 | 6,373 % éch. 15/07/2026 | 32 250 | 32 636 | 0,05 |
| 8,248 % éch. 21/11/2033 | 3 900 | 4 235 | 0,01 | 5,846 % éch. 22/12/2036 | 362 | 329 | 0,00 | 6,442 % éch. 11/08/2028 | 115 850 | 120 385 | 0,17 |
| JPMorgan Chase & Co. | | | | 5,936 % éch. 22/06/2037 | 13 278 | 11 685 | 0,02 | 6,537 % éch. 12/08/2033 | 102 073 | 108 991 | 0,15 |
| 2,083 % éch. 22/04/2026 | 3 100 | 2 970 | 0,00 | 5,946 % éch. 22/03/2037 | 15 905 | 14 473 | 0,02 | 7,375 % éch. 07/09/2033 | £ 6 500 | 9 560 | 0,01 |
| 3,509 % éch. 23/01/2029 | 3 500 | 3 319 | 0,00 | 5,946 % éch. 22/09/2037 | 15 903 | 13 517 | 0,02 | 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 108 880 | 138 774 | 0,20 |
| 3,960 % éch. 29/01/2027 | 7 000 | 6 841 | 0,01 | 5,956 % éch. 22/12/2036 | 19 295 | 18 234 | 0,03 | 9,016 % éch. 15/11/2033 | \$ 38 550 | 47 417 | 0,07 |
| 4,005 % éch. 23/04/2029 | 7 000 | 6 741 | 0,01 | 5,986 % éch. 22/09/2036 | 1 108 | 1 030 | 0,00 | Unique Pub Finance Co. PLC | | | |
| 6,070 % éch. 22/10/2027 | 95 400 | 98 177 | 0,14 | 5,996 % éch. 22/12/2035 | 9 146 | 8 460 | 0,01 | 7,395 % éch. 28/03/2024 | £ 586 | 746 | 0,00 |
| 6,087 % éch. 23/10/2029 | 88 860 | 93 475 | 0,13 | 6,016 % éch. 22/09/2037 | 11 769 | 9 298 | 0,01 | Uniti Group LP | | | |
| 6,254 % éch. 23/10/2034 | 49 400 | 53 578 | 0,08 | 6,026 % éch. 23/09/2035 | 437 | 435 | 0,00 | 4,750 % éch. 15/04/2028 | \$ 11 366 | 9 808 | 0,01 |
| Kaisa Group Holdings Ltd. | | | | 6,026 % éch. 22/03/2037 | 13 130 | 9 979 | 0,01 | 10,500 % éch. 15/02/2028 | 72 952 | 74 021 | 0,11 |
| 9,375 % éch. 30/06/2024 ^ | 1 800 | 65 | 0,00 | 6,046 % éch. 22/03/2038 | 4 532 | 4 079 | 0,01 | Ursa Re Ltd. | | | |
| 9,750 % éch. 28/09/2023 ^ | 800 | 29 | 0,00 | 6,076 % éch. 22/12/2035 | 2 164 | 1 818 | 0,00 | 10,871 % éch. 07/12/2026 | 19 400 | 19 399 | 0,03 |
| 10,500 % éch. 15/01/2025 ^ | 400 | 15 | 0,00 | 6,096 % éch. 22/03/2038 | 9 085 | 7 858 | 0,01 | 14,121 % éch. 07/12/2026 | 24 900 | 24 898 | 0,04 |
| 11,250 % éch. 16/04/2025 ^ | 800 | 26 | 0,00 | 6,126 % éch. 23/09/2035 | 6 643 | 5 879 | 0,01 | VICI Properties LP | | | |
| 11,500 % éch. 30/01/2023 ^ | 600 | 20 | 0,00 | 6,226 % éch. 23/03/2035 | 10 000 | 8 750 | 0,01 | 3,500 % éch. 15/02/2025 | 42 516 | 41 455 | 0,06 |
| 11,700 % éch. 11/11/2025 ^ | 2 600 | 94 | 0,00 | 6,482 % éch. 03/07/2033 | 274 | 261 | 0,00 | 3,750 % éch. 15/02/2027 | 39 100 | 36 933 | 0,05 |
| 11,950 % éch. 12/11/2023 ^ | 800 | 29 | 0,00 | 6,546 % éch. 22/03/2038 | 735 | 705 | 0,00 | 3,875 % éch. 15/02/2029 | 14 180 | 13 037 | 0,02 |
| KBC Group NV | | | | Realkredit Danmark A/S | | | | 4,125 % éch. 15/08/2030 | 10 116 | 9 225 | 0,01 |
| 5,796 % éch. 19/01/2029 | 16 350 | 16 640 | 0,02 | 2,500 % éch. 01/04/2047 DKK | 0 | 0 | 0,00 | 4,250 % éch. 01/12/2026 | 31 400 | 30 238 | 0,04 |
| 6,324 % éch. 21/09/2034 | 75 200 | 79 527 | 0,11 | Santander UK Group Holdings PLC | | | | 4,500 % éch. 01/09/2026 | 11 028 | 10 682 | 0,02 |
| Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. | | | | 2,469 % éch. 11/01/2028 | \$ 5 600 | 5 108 | 0,01 | 4,500 % éch. 15/01/2028 | 2 000 | 1 909 | 0,00 |
| 3,250 % éch. 12/11/2025 (m) | € 9 400 | 9 437 | 0,01 | 3,823 % éch. 03/11/2028 | 25 600 | 24 078 | 0,03 | 4,625 % éch. 15/06/2025 | 5 648 | 5 551 | 0,01 |
| Kilroy Realty LP | | | | 6,534 % éch. 10/01/2029 | 47 000 | 48 685 | 0,07 | 4,625 % éch. 01/12/2029 | 32 600 | 30 750 | 0,04 |
| 2,650 % éch. 15/11/2033 | \$ 2 400 | 1 823 | 0,00 | 6,750 % éch. 24/06/2024 (i)(k) | £ 65 803 | 83 958 | 0,12 | 5,625 % éch. 01/05/2024 | 9 505 | 9 480 | 0,01 |
| 4,250 % éch. 15/08/2029 | 1 500 | 1 377 | 0,00 | 6,833 % éch. 21/11/2026 | \$ 21 600 | 22 013 | 0,03 | 5,750 % éch. 01/02/2027 | 25 355 | 25 450 | 0,04 |
| Lloyds Banking Group PLC | | | | 7,482 % éch. 29/08/2029 | £ 52 550 | 72 911 | 0,10 | Voyager Aviation Holdings LLC | | | |
| 3,750 % éch. 11/01/2027 | 24 761 | 23 785 | 0,03 | SBA Tower Trust | | | | 8,500 % éch. 09/05/2026 ^ | 4 668 | 2 538 | 0,00 |
| 4,750 % éch. 21/09/2031 | € 41 600 | 48 623 | 0,07 | 2,836 % éch. 15/01/2050 | \$ 5 885 | 5 685 | 0,01 | Wells Fargo & Co. | | | |
| 7,875 % éch. 27/06/2029 (i)(k) | £ 28 220 | 35 279 | 0,05 | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | | 2,188 % éch. 30/04/2026 | 6 600 | 6 329 | 0,01 |
| | | | | 5,125 % éch. 29/10/2022 ^ | 6 100 | 366 | 0,00 | 4,478 % éch. 04/04/2031 | 13 200 | 12 763 | 0,02 |
| | | | | Seazen Group Ltd. | | | | 4,540 % éch. 15/08/2026 | 11 000 | 10 889 | 0,02 |
| | | | | 4,450 % éch. 13/07/2025 | 1 900 | 560 | 0,00 | 4,897 % éch. 25/07/2033 | 8 800 | 8 578 | 0,01 |
| | | | | 6,000 % éch. 12/08/2024 | 5 000 | 2 800 | 0,00 | 5,389 % éch. 24/04/2034 | 17 600 | 17 687 | 0,03 |
| | | | | SLM Corp. | | | | 5,557 % éch. 25/07/2034 | 28 000 | 28 522 | 0,04 |
| | | | | 4,200 % éch. 29/10/2025 | 2 686 | 2 608 | 0,00 | 6,303 % éch. 23/10/2029 | | | |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Yango Group Co. Ltd. 6,900 % éch. 31/10/2022 ^ | CNY 50 000 | \$ 995 | 0,00 | 3,900 % éch. 01/06/2052 | \$ 89 600 | \$ 60 344 | 0,09 | Noble Finance LLC 8,000 % éch. 15/04/2030 | \$ 5 779 | \$ 6 018 | 0,01 |
| | | 8 649 588 | 12,26 | 3,950 % éch. 30/06/2062 | 21 300 | 13 424 | 0,02 | NPC Ukrenegro 6,875 % éch. 09/11/2028 | 1 000 | 272 | 0,00 |
| | | | | 4,400 % éch. 01/12/2061 | 38 000 | 26 303 | 0,04 | Oracle Corp. 3,850 % éch. 01/04/2060 | 2 776 | 2 016 | 0,00 |
| INDUSTRIE | | | | Community Health Systems, Inc. 5,625 % éch. 15/03/2027 | 79 160 | 73 654 | 0,10 | 4,100 % éch. 25/03/2061 (I) | 13 100 | 10 003 | 0,01 |
| Air Canada Pass-Through Trust 5,250 % éch. 01/10/2030 | \$ 32 406 | 31 808 | 0,05 | 8,000 % éch. 15/03/2026 | 33 087 | 33 007 | 0,05 | PeaceHealth Obligated Group 3,218 % éch. 15/11/2050 | 13 300 | 8 743 | 0,01 |
| Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % éch. 15/02/2029 | 19 407 | 18 886 | 0,03 | Constellation Oil Services Holding S.A. 13,500 % éch. 30/06/2025 | 1 150 | 1 140 | 0,00 | Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % éch. 12/04/2037 | 53 114 | 5 922 | 0,01 |
| Altice Financing S.A. 5,750 % éch. 15/08/2029 | 63 003 | 55 994 | 0,08 | Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) 3,000 % éch. 31/12/2026 (d) | 2 993 | 2 178 | 0,00 | 5,500 % éch. 12/04/2047 | 50 574 | 5 690 | 0,01 |
| Altice France S.A. 8,125 % éch. 01/02/2027 | 24 392 | 22 505 | 0,03 | CoStar Group, Inc. 2,800 % éch. 15/07/2030 | 11 362 | 9 669 | 0,01 | 6,000 % éch. 16/05/2034 | 47 576 | 5 470 | 0,01 |
| Amdocs Ltd. 2,538 % éch. 15/06/2030 | 3 500 | 3 021 | 0,00 | CVS Pass-Through Trust 4,163 % éch. 11/08/2036 | 1 366 | 1 218 | 0,00 | 6,000 % éch. 15/11/2036 | 63 177 | 7 344 | 0,01 |
| American Airlines Pass-Through Trust 2,875 % éch. 11/01/2036 | 14 394 | 12 244 | 0,02 | 4,704 % éch. 10/01/2036 | 5 109 | 4 748 | 0,01 | 9,750 % éch. 17/05/2045 | 28 330 | 3 683 | 0,01 |
| 3,000 % éch. 15/04/2030 | 2 641 | 2 387 | 0,00 | 5,926 % éch. 10/01/2034 | 715 | 725 | 0,00 | Petroleos Mexicanos 2,750 % éch. 21/04/2027 | € 3 000 | 2 796 | 0,00 |
| 3,150 % éch. 15/08/2033 | 729 | 639 | 0,00 | 6,036 % éch. 10/12/2028 | 2 347 | 2 371 | 0,00 | 5,950 % éch. 28/01/2031 | \$ 43 161 | 34 518 | 0,05 |
| 3,200 % éch. 15/12/2029 | 3 103 | 2 829 | 0,00 | 6,943 % éch. 10/01/2030 | 4 827 | 4 932 | 0,01 | 6,700 % éch. 16/02/2032 | 303 442 | 252 148 | 0,36 |
| 3,350 % éch. 15/04/2031 | 9 840 | 8 898 | 0,01 | 7,507 % éch. 10/01/2032 | 5 671 | 5 967 | 0,01 | 6,750 % éch. 21/09/2047 | 2 466 | 1 617 | 0,00 |
| 3,375 % éch. 01/11/2028 | 22 982 | 21 082 | 0,03 | 8,353 % éch. 10/07/2031 | 4 448 | 4 804 | 0,01 | 6,950 % éch. 28/01/2060 | 60 850 | 40 153 | 0,06 |
| 3,575 % éch. 15/07/2029 | 9 274 | 8 659 | 0,01 | Delta Air Lines Pass-Through Trust 2,000 % éch. 10/12/2029 | 198 | 176 | 0,00 | 7,690 % éch. 23/01/2050 | 9 240 | 6 583 | 0,01 |
| 3,600 % éch. 22/03/2029 | 1 741 | 1 631 | 0,00 | DISH DBS Corp. 5,250 % éch. 01/12/2026 | 72 570 | 62 310 | 0,09 | Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % éch. 01/11/2025 | 35 984 | 35 124 | 0,05 |
| 3,700 % éch. 01/04/2028 | 29 456 | 27 439 | 0,04 | 5,750 % éch. 01/12/2028 | 81 200 | 64 917 | 0,09 | Prosus NV 1,985 % éch. 13/07/2033 | € 10 500 | 8 603 | 0,01 |
| 4,000 % éch. 15/01/2027 | 273 | 262 | 0,00 | Energy Transfer LP 4,950 % éch. 15/05/2028 | 2 500 | 2 490 | 0,00 | 2,085 % éch. 19/01/2030 | 3 900 | 3 612 | 0,01 |
| 4,000 % éch. 15/08/2030 | 5 078 | 4 560 | 0,01 | 6,050 % éch. 01/12/2026 | 18 300 | 18 825 | 0,03 | 2,778 % éch. 19/01/2034 | 8 700 | 7 517 | 0,01 |
| Baptist Healthcare System Obligated Group 3,540 % éch. 15/08/2050 | 13 100 | 9 679 | 0,01 | 6,100 % éch. 01/12/2028 | 6 250 | 6 581 | 0,01 | 3,061 % éch. 13/07/2031 | \$ 4 600 | 3 719 | 0,01 |
| BAT Capital Corp. 6,343 % éch. 02/08/2030 | 5 300 | 5 569 | 0,01 | 6,400 % éch. 01/12/2030 | 25 000 | 26 758 | 0,04 | 4,193 % éch. 19/01/2032 | 3 700 | 3 195 | 0,00 |
| 6,421 % éch. 02/08/2033 | 4 300 | 4 503 | 0,01 | Exela Intermediate LLC 11,500 % éch. 15/04/2026 | 5 011 | 902 | 0,00 | RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % éch. 01/12/2026 | 2 700 | 2 682 | 0,00 |
| BAT International Finance PLC 5,931 % éch. 02/02/2029 | 50 000 | 51 985 | 0,07 | Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,250 % éch. 22/11/2024 | € 500 | 442 | 0,00 | Roadster Finance DAC 2,375 % éch. 08/12/2032 | € 7 000 | 6 826 | 0,01 |
| Bayer U.S. Finance LLC 6,125 % éch. 21/11/2026 | 15 000 | 15 256 | 0,02 | 2,949 % éch. 24/01/2024 | 56 890 | 51 846 | 0,07 | Rolls-Royce PLC 4,625 % éch. 16/02/2026 | 17 996 | 20 273 | 0,03 |
| 6,250 % éch. 21/01/2029 | 20 500 | 20 972 | 0,03 | 4,250 % éch. 08/04/2024 | € 500 | 519 | 0,00 | 5,750 % éch. 15/10/2027 | € 9 371 | 12 021 | 0,02 |
| 6,375 % éch. 21/11/2030 | 15 700 | 16 165 | 0,02 | 4,950 % éch. 23/03/2027 | \$ 20 300 | 14 108 | 0,02 | RTX Corp. 5,750 % éch. 08/11/2026 | \$ 25 000 | 25 696 | 0,04 |
| 6,500 % éch. 21/11/2033 | 30 000 | 31 024 | 0,04 | 4,950 % éch. 06/02/2028 | 24 600 | 17 097 | 0,02 | 5,750 % éch. 15/01/2029 | 23 250 | 24 318 | 0,03 |
| 6,875 % éch. 21/11/2053 | 14 100 | 15 032 | 0,02 | 5,150 % éch. 11/02/2026 | 32 700 | 24 525 | 0,04 | Russian Railways Via RZD Capital PLC 7,487 % éch. 25/03/2031 ^ | € 13 950 | 11 559 | 0,02 |
| Biocceanico Sovereign Certificate Ltd. 0,000 % éch. 05/06/2034 (f) | 1 171 | 839 | 0,00 | 7,288 % éch. 16/08/2037 | 18 510 | 14 931 | 0,02 | Sandoz Finance BV 3,970 % éch. 17/04/2027 | € 15 000 | 16 913 | 0,02 |
| Boeing Co. 5,705 % éch. 01/05/2040 | 16 239 | 16 807 | 0,02 | 8,625 % éch. 28/04/2034 | 38 699 | 35 291 | 0,05 | 4,220 % éch. 17/04/2030 | 5 000 | 5 740 | 0,01 |
| 5,805 % éch. 01/05/2050 | 58 907 | 61 042 | 0,09 | Global Payments, Inc. 1,200 % éch. 01/03/2026 | 2 664 | 2 449 | 0,00 | 4,500 % éch. 17/11/2033 | 10 000 | 11 746 | 0,02 |
| 5,930 % éch. 01/05/2060 | 65 888 | 68 345 | 0,10 | Greene King Finance PLC 4,064 % éch. 15/03/2035 | € 3 683 | 4 295 | 0,01 | Sands China Ltd. 4,300 % éch. 08/01/2026 | \$ 9 337 | 8 972 | 0,01 |
| British Airways Pass-Through Trust 2,900 % éch. 15/09/2036 | 7 029 | 6 025 | 0,01 | 5,106 % éch. 15/03/2034 | 2 969 | 3 679 | 0,01 | 5,375 % éch. 08/08/2025 | 21 176 | 20 896 | 0,03 |
| 3,300 % éch. 15/06/2034 | 3 221 | 2 870 | 0,00 | GTCR W-2 Merger Sub LLC 7,500 % éch. 15/01/2031 | \$ 3 300 | 3 489 | 0,01 | 5,650 % éch. 08/08/2028 | 21 010 | 20 848 | 0,03 |
| 3,800 % éch. 20/03/2033 | 2 306 | 2 160 | 0,00 | Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % éch. 18/03/2033 | € 5 290 | 4 585 | 0,01 | Spirit Airlines Pass-Through Trust 4,100 % éch. 01/10/2029 | 1 633 | 1 502 | 0,00 |
| 4,250 % éch. 15/05/2034 | 6 303 | 5 885 | 0,01 | Imperial Brands Finance PLC 3,500 % éch. 26/07/2026 | \$ 3 094 | 2 953 | 0,00 | Sprint Spectrum Co. LLC 4,738 % éch. 20/09/2029 | 5 217 | 5 175 | 0,01 |
| Broadcom, Inc. 2,450 % éch. 15/02/2031 | 41 000 | 35 083 | 0,05 | Integrus Baptist Medical Center, Inc. 3,875 % éch. 15/08/2050 | 10 500 | 8 070 | 0,01 | Sutter Health 3,161 % éch. 15/08/2040 | 1 500 | 1 178 | 0,00 |
| 2,600 % éch. 15/02/2033 | 10 810 | 8 911 | 0,01 | Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % éch. 15/03/2030 | 337 627 | 322 469 | 0,46 | 3,361 % éch. 15/08/2050 | 16 300 | 12 111 | 0,02 |
| 3,137 % éch. 15/11/2035 | 2 408 | 1 978 | 0,00 | IQVIA, Inc. 6,250 % éch. 01/02/2029 | 14 600 | 15 260 | 0,02 | Syngenta Finance NV 4,892 % éch. 24/04/2025 | 4 948 | 4 884 | 0,01 |
| 3,187 % éch. 15/11/2036 | 61 996 | 50 273 | 0,07 | JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % éch. 15/05/2034 | 37 657 | 34 567 | 0,05 | Times Square Hotel Trust 8,528 % éch. 01/08/2026 | 1 272 | 1 270 | 0,00 |
| 3,419 % éch. 15/04/2033 | 13 920 | 12 232 | 0,02 | Las Vegas Sands Corp. 3,200 % éch. 08/08/2024 | 5 950 | 5 838 | 0,01 | Topaz Solar Farms LLC 4,875 % éch. 30/09/2039 | 5 258 | 4 856 | 0,01 |
| 3,469 % éch. 15/04/2034 | 73 631 | 64 092 | 0,09 | Market Bidco Finco PLC 4,750 % éch. 04/11/2027 | € 103 700 | 103 022 | 0,15 | 5,750 % éch. 30/09/2039 | 44 878 | 44 682 | 0,06 |
| California Institute of Technology 4,283 % éch. 01/09/2116 | 9 100 | 7 219 | 0,01 | Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % éch. 15/12/2030 | € 5 469 | 6 616 | 0,01 | U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % éch. 15/05/2027 | 2 469 | 2 361 | 0,00 |
| Carvana Co. 12,000 % éch. 01/12/2028 | 55 640 | 45 052 | 0,06 | 6,135 % éch. 15/12/2030 | \$ 3 658 | 3 397 | 0,01 | U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % éch. 28/06/2028 | 3 879 | 2 977 | 0,00 |
| 13,000 % éch. 01/06/2030 | 88 679 | 70 842 | 0,10 | Nefflix, Inc. 3,875 % éch. 15/11/2029 | € 18 758 | 21 470 | 0,03 | United Airlines Pass-Through Trust 2,700 % éch. 01/11/2033 | 19 345 | 16 408 | 0,02 |
| 14,000 % éch. 01/06/2031 | 109 179 | 88 269 | 0,13 | Nissan Motor Co. Ltd. 3,522 % éch. 17/09/2025 | \$ 58 000 | 55 866 | 0,08 | 3,500 % éch. 01/09/2031 | 1 899 | 1 734 | 0,00 |
| CDW LLC 2,670 % éch. 01/12/2026 | 7 600 | 7 118 | 0,01 | 4,345 % éch. 17/09/2027 | 82 724 | 79 200 | 0,11 | 3,750 % éch. 03/03/2028 | 7 635 | 7 283 | 0,01 |
| 3,569 % éch. 01/12/2031 | 26 300 | 23 359 | 0,03 | 4,810 % éch. 17/09/2030 | 43 097 | 40 318 | 0,06 | 4,000 % éch. 11/10/2027 | 482 | 460 | 0,00 |
| Cellnex Finance Co. S.A. 3,875 % éch. 07/07/2041 | 6 300 | 4 885 | 0,01 | NMG Holding Co., Inc. 7,125 % éch. 01/04/2026 | 92 700 | 89 154 | 0,13 | 4,150 % éch. 11/10/2025 | 2 528 | 2 517 | 0,00 |
| CGI, Inc. 1,450 % éch. 14/09/2026 | 8 100 | 7 351 | 0,01 | | | | | 4,150 % éch. 25/02/2033 | 727 | 672 | 0,00 |
| Charter Communications Operating LLC 3,850 % éch. 01/04/2061 | 6 100 | 3 807 | 0,01 | | | | | 5,875 % éch. 15/04/2029 | 96 562 | 97 875 | 0,14 |
| | | | | | | | | Valaris Ltd. 8,375 % éch. 30/04/2030 | 1 327 | 1 361 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|------------------------------|--------|------|
| 5,500 % éch. 01/12/2034 - 01/12/2053 | \$ 2 409 309 | \$ 2 421 660 | 3,43 | 2,000 % éch. 15/11/2026 | \$ 9 100 | \$ 8 604 | 0,01 | Ashford Hospitality Trust | | | | | |
| 6,000 % éch. 01/08/2031 - 01/11/2053 | 2 751 428 | 2 796 738 | 3,96 | 2,125 % éch. 15/05/2025 | 132 200 | 128 007 | 0,18 | 6,434 % éch. 15/04/2035 | \$ 927 | \$ 916 | 0,00 | | |
| 6,500 % éch. 01/09/2024 - 01/10/2053 | 1 484 110 | 1 521 390 | 2,16 | 2,250 % éch. 15/11/2025 | 57 430 | 55 323 | 0,08 | 6,784 % éch. 15/04/2035 | 3 000 | 2 938 | 0,01 | | |
| 7,500 % éch. 01/04/2029 - 01/10/2030 | 1 | 0 | 0,00 | 2,250 % éch. 15/02/2027 | 262 600 | 249 332 | 0,35 | 6,934 % éch. 15/04/2035 | 2 500 | 2 446 | 0,00 | | |
| 8,000 % éch. 01/03/2030 | 0 | 0 | 0,00 | 2,375 % éch. 31/03/2029 | 139 700 | 129 725 | 0,18 | Atlas Funding PLC | | | | | |
| 8,500 % éch. 01/04/2025 | 0 | 0 | 0,00 | 2,375 % éch. 15/05/2029 | 255 400 | 236 774 | 0,34 | 6,120 % éch. 25/07/2058 | £ 20 201 | 25 769 | 0,04 | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | 2,625 % éch. 31/01/2026 | 631 400 | 611 644 | 0,87 | 6,348 % éch. 20/01/2061 | 27 098 | 34 718 | 0,05 | | |
| 2,000 % éch. 01/01/2039 | 200 | 179 | 0,00 | 2,750 % éch. 15/08/2032 | 832 400 | 762 540 | 1,08 | Atrium Hotel Portfolio Trust | | | | | |
| 2,500 % éch. 01/01/2039 - 01/02/2054 | 4 | | | 2,875 % éch. 15/08/2028 | 500 | 479 | 0,00 | 6,589 % éch. 15/12/2036 | \$ 37 889 | 36 049 | 0,05 | | |
| 3,000 % éch. 01/01/2039 - 01/03/2054 | 1 350 | 1 241 | 0,00 | 2,875 % éch. 15/05/2032 | 171 690 | 159 159 | 0,23 | 7,159 % éch. 15/12/2036 | 4 000 | 3 674 | 0,01 | | |
| 3,500 % éch. 01/01/2054 | 3 334 184 | 3 061 832 | 4,34 | 4,000 % éch. 31/10/2029 | 592 900 | 595 783 | 0,84 | 7,959 % éch. 15/06/2035 | 47 513 | 45 561 | 0,07 | | |
| 4,000 % éch. 01/01/2054 | 1 762 853 | 1 668 767 | 2,37 | | | | 15 095 389 | 21,40 | Avon Finance PLC | | | | |
| 4,500 % éch. 01/01/2054 | 2 274 300 | 2 206 123 | 3,13 | | | | | | 0,000 % éch. 28/12/2049 | £ 47 000 | 59 789 | 0,09 | |
| 5,000 % éch. 01/01/2054 | 5 207 864 | 5 153 819 | 7,31 | | | | | | Banc of America Alternative Loan Trust | | | | |
| 5,500 % éch. 01/01/2054 | 5 466 360 | 5 490 555 | 7,78 | | | | | | 5,500 % éch. 25/12/2035 | \$ 149 | 127 | 0,00 | |
| 6,000 % éch. 01/01/2054 | 6 659 100 | 6 762 037 | 9,59 | | | | | | 5,870 % éch. 25/01/2037 | 1 708 | 1 278 | 0,00 | |
| 6,500 % éch. 01/01/2054 | 4 051 000 | 4 151 292 | 5,89 | | | | | | 5,913 % éch. 25/10/2036 | 9 825 | 2 857 | 0,01 | |
| 7,000 % éch. 01/03/2054 | 476 000 | 490 187 | 0,70 | | | | | | 6,000 % éch. 25/11/2035 | 186 | 158 | 0,00 | |
| | | 44 437 876 | 62,99 | | | | | | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 356 | 286 | 0,00 | |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | | | | | | | 6,000 % éch. 25/06/2037 | 470 | 388 | 0,00 |
| Obligations du Trésor américain | | | | | | | | | | 6,000 % éch. 25/06/2046 | 2 027 | 1 562 | 0,00 |
| 2,500 % éch. 15/02/2045 | 59 000 | 44 699 | 0,06 | | | | | | | 6,000 % éch. 25/07/2046 | 1 343 | 1 135 | 0,00 |
| 2,875 % éch. 15/05/2043 | 69 079 | 56 736 | 0,08 | | | | | | | 6,500 % éch. 25/03/2036 | 1 710 | 1 503 | 0,00 |
| 2,875 % éch. 15/08/2045 | 510 010 | 411 435 | 0,58 | | | | | | | Banc of America Funding Corp. | | | |
| 3,000 % éch. 15/11/2044 | 371 252 | 307 414 | 0,44 | | | | | | | 4,407 % éch. 25/09/2048 | 1 557 | 1 423 | 0,00 |
| 3,000 % éch. 15/08/2048 | 81 815 | 66 628 | 0,09 | | | | | | | Banc of America Funding Trust | | | |
| 3,000 % éch. 15/02/2049 | 10 169 | 8 279 | 0,01 | | | | | | | 3,369 % éch. 29/04/2037 | 7 118 | 6 394 | 0,01 |
| 3,125 % éch. 15/02/2043 | 178 076 | 152 290 | 0,22 | | | | | | | 3,806 % éch. 20/05/2035 | 725 | 632 | 0,00 |
| 3,125 % éch. 15/08/2044 | 283 117 | 239 842 | 0,34 | | | | | | | 4,222 % éch. 26/10/2036 | 9 406 | 8 872 | 0,01 |
| 3,125 % éch. 15/05/2048 | 55 840 | 46 543 | 0,07 | | | | | | | 4,306 % éch. 20/01/2047 | 152 | 125 | 0,00 |
| 3,375 % éch. 15/05/2044 | 416 095 | 367 025 | 0,52 | | | | | | | 4,391 % éch. 27/08/2036 | 15 536 | 14 499 | 0,02 |
| 3,625 % éch. 15/02/2044 | 145 436 | 133 313 | 0,19 | | | | | | | 4,427 % éch. 20/05/2036 | 213 | 184 | 0,00 |
| 3,750 % éch. 15/11/2043 | 80 988 | 75 721 | 0,11 | | | | | | | 4,446 % éch. 20/11/2035 | 3 048 | 2 562 | 0,00 |
| 4,375 % éch. 15/08/2043 | 208 600 | 213 000 | 0,30 | | | | | | | 4,482 % éch. 20/07/2047 | 834 | 789 | 0,00 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (h) | | | | | | | | | | 4,699 % éch. 20/06/2047 | 4 744 | 4 156 | 0,01 |
| 0,125 % éch. 15/07/2024 | 1 321 763 | 1 299 165 | 1,84 | | | | | | | 4,718 % éch. 20/09/2046 | 80 | 65 | 0,00 |
| 0,125 % éch. 15/10/2024 | 1 153 892 | 1 128 828 | 1,60 | | | | | | | 4,733 % éch. 20/05/2036 | 1 046 | 959 | 0,00 |
| 0,125 % éch. 15/04/2025 | 187 934 | 181 243 | 0,26 | | | | | | | 4,817 % éch. 20/09/2035 | 2 305 | 1 818 | 0,00 |
| 0,125 % éch. 15/07/2030 | 309 089 | 279 381 | 0,40 | | | | | | | 4,934 % éch. 20/06/2032 | 3 | 3 | 0,00 |
| 0,125 % éch. 15/01/2031 | 11 347 | 10 133 | 0,01 | | | | | | | 4,953 % éch. 20/02/2036 | 40 | 32 | 0,00 |
| 0,125 % éch. 15/07/2031 | 59 498 | 52 927 | 0,07 | | | | | | | 5,061 % éch. 20/01/2047 | 1 618 | 1 387 | 0,00 |
| 0,125 % éch. 15/01/2032 | 48 613 | 42 723 | 0,06 | | | | | | | 5,168 % éch. 20/05/2036 | 219 | 195 | 0,00 |
| 0,250 % éch. 15/01/2025 | 826 203 | 802 021 | 1,14 | | | | | | | 5,404 % éch. 20/11/2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| 0,250 % éch. 15/07/2029 | 884 442 | 817 736 | 1,16 | | | | | | | 5,478 % éch. 20/07/2036 | 85 | 80 | 0,00 |
| 0,250 % éch. 15/02/2050 | 116 203 | 75 860 | 0,11 | | | | | | | 5,490 % éch. 20/02/2036 | 45 | 42 | 0,00 |
| 0,375 % éch. 15/01/2027 | 19 387 | 18 428 | 0,03 | | | | | | | 5,500 % éch. 26/07/2035 | 115 | 95 | 0,00 |
| 0,375 % éch. 15/07/2027 | 5 232 | 4 973 | 0,01 | | | | | | | 5,500 % éch. 25/01/2036 | 33 | 32 | 0,00 |
| 0,500 % éch. 15/04/2024 | 544 914 | 538 054 | 0,76 | | | | | | | 5,500 % éch. 25/03/2036 | 44 | 38 | 0,00 |
| 0,625 % éch. 15/01/2024 | 953 520 | 950 991 | 1,35 | | | | | | | 5,530 % éch. 25/01/2037 | 2 194 | 1 900 | 0,00 |
| 0,625 % éch. 15/07/2032 | 532 862 | 487 129 | 0,69 | | | | | | | 5,570 % éch. 25/04/2037 | 3 090 | 2 529 | 0,00 |
| 0,625 % éch. 15/02/2043 | 16 193 | 12 663 | 0,02 | | | | | | | 5,599 % éch. 20/11/2035 | 202 | 184 | 0,00 |
| 0,750 % éch. 15/07/2028 | 172 629 | 165 266 | 0,23 | | | | | | | 5,657 % éch. 20/11/2034 | 36 | 35 | 0,00 |
| 0,750 % éch. 15/02/2042 | 45 887 | 37 232 | 0,05 | | | | | | | 5,680 % éch. 26/05/2037 | 6 458 | 5 591 | 0,01 |
| 0,750 % éch. 15/02/2045 | 152 439 | 119 322 | 0,17 | | | | | | | 5,717 % éch. 20/07/2036 | 5 061 | 4 112 | 0,01 |
| 0,875 % éch. 15/01/2029 | 207 497 | 198 653 | 0,28 | | | | | | | 5,750 % éch. 25/11/2035 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0,875 % éch. 15/02/2047 | 117 899 | 93 025 | 0,13 | | | | | | | 5,750 % éch. 25/03/2036 | 102 | 77 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 15/02/2046 | 63 237 | 51 791 | 0,07 | | | | | | | 5,773 % éch. 25/05/2037 | 81 | 70 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 15/02/2048 | 140 116 | 113 195 | 0,16 | | | | | | | 5,792 % éch. 20/02/2047 | 2 978 | 2 570 | 0,00 |
| 1,000 % éch. 15/02/2049 | 368 546 | 297 036 | 0,42 | | | | | | | 5,846 % éch. 25/01/2037 | 184 | 161 | 0,00 |
| 1,125 % éch. 15/01/2033 | 52 263 | 49 478 | 0,07 | | | | | | | 5,852 % éch. 20/10/2036 | 7 476 | 5 602 | 0,01 |
| 1,375 % éch. 15/07/2033 | 880 158 | 853 999 | 1,21 | | | | | | | 5,852 % éch. 20/12/2046 | 2 336 | 1 915 | 0,00 |
| 1,375 % éch. 15/02/2044 | 17 690 | 15 829 | 0,02 | | | | | | | 5,892 % éch. 20/04/2047 | 765 | 602 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 15/02/2053 | 167 473 | 151 999 | 0,22 | | | | | | | 5,892 % éch. 20/05/2047 | 6 244 | 5 624 | 0,01 |
| 2,125 % éch. 15/02/2040 | 23 345 | 23 998 | 0,03 | | | | | | | 5,892 % éch. 20/06/2047 | 533 | 419 | 0,00 |
| 2,125 % éch. 15/02/2041 | 10 537 | 10 832 | 0,02 | | | | | | | 6,000 % éch. 25/07/2036 | 534 | 371 | 0,00 |
| 2,375 % éch. 15/01/2025 | 46 846 | 46 843 | 0,07 | | | | | | | 6,000 % éch. 25/08/2036 | 216 | 177 | 0,00 |
| Billets du Trésor américain | | | | | | | | | | 6,000 % éch. 25/08/2036 | 189 | 162 | 0,00 |
| 0,375 % éch. 30/09/2027 | 38 660 | 33 914 | 0,05 | | | | | | | 6,000 % éch. 25/09/2036 | 613 | 509 | 0,00 |
| 0,500 % éch. 31/10/2027 | 46 600 | 40 977 | 0,06 | | | | | | | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 1 386 | 1 092 | 0,00 |
| 0,625 % éch. 30/11/2027 | 542 910 | 478 609 | 0,68 | | | | | | | 6,000 % éch. 26/10/2037 | 1 251 | 1 107 | 0,00 |
| 0,625 % éch. 31/12/2027 | 230 260 | 202 494 | 0,29 | | | | | | | 6,030 % éch. 25/07/2037 | 184 | 172 | 0,00 |
| 0,750 % éch. 31/01/2028 | 199 210 | 175 667 | 0,25 | | | | | | | 6,032 % éch. 20/06/2047 | 2 193 | 1 737 | 0,00 |
| 1,500 % éch. 15/08/2026 | 56 200 | 52 608 | 0,07 | | | | | | | 6,050 % éch. 25/05/2037 | 4 299 | 3 565 | 0,01 |
| 2,000 % éch. 15/02/2025 | 15 000 | 14 561 | 0,02 | | | | | | | 6,050 % éch. 25/07/2037 | 1 809 | 1 688 | 0,00 |
| 2,000 % éch. 15/08/2025 | 110 000 | 105 871 | 0,15 | | | | | | | 6,072 % éch. 20/05/2047 | 1 435 | 1 304 | 0,00 |
| | | | | | | | | | | 6,253 % éch. 25/10/2036 | 8 | 7 | 0,00 |
| | | | | | | | | | | 6,263 % éch. 25/10/2036 | 176 | 151 | 0,00 |
| | | | | | | | | | | 6,347 % éch. 25/01/2037 | 574 | 516 | 0,00 |
| | | | | | | | | | | 6,479 % éch. 25/10/2036 | 476 | 408 | 0,00 |
| | | | | | | | | | | 7,678 % éch. 20/07/2036 | 1 009 | 992 | 0,00 |
| | | | | | | | | | | Banc of America Merrill Lynch Trust | | | |
| | | | | | | | | | | 2,848 % éch. 14/08/2034 | 4 000 | 3 143 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,027 % éch. 25/04/2035 | \$ 383 | \$ 362 | 0,00 | 5,820 % éch. 25/10/2036 | \$ 1 476 | \$ 715 | 0,00 | 6,570 % éch. 25/02/2036 | \$ 66 | \$ 51 | 0,00 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates | | | | 5,820 % éch. 25/11/2036 | 4 954 | 4 107 | 0,01 | 6,612 % éch. 25/08/2035 | 1 784 | 1 431 | 0,00 |
| 4,150 % éch. 25/09/2035 | 1 293 | 1 145 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/09/2046 | 1 848 | 1 569 | 0,00 | 6,657 % éch. 25/06/2035 | 1 926 | 1 677 | 0,00 |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust | | | | 5,830 % éch. 25/05/2047 | 280 | 238 | 0,00 | 6,750 % éch. 25/10/2036 | 1 411 | 399 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/04/2036 | 213 | 185 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/06/2047 | 4 357 | 3 576 | 0,01 | 7,000 % éch. 25/10/2037 | 5 565 | 2 092 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/12/2036 | 1 686 | 1 448 | 0,00 | 5,840 % éch. 25/02/2037 | 736 | 259 | 0,00 | 7,500 % éch. 25/07/2036 | 1 790 | 1 235 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/02/2037 | 518 | 457 | 0,00 | 5,850 % éch. 25/07/2046 | 1 359 | 1 340 | 0,00 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | |
| 5,750 % éch. 25/03/2037 | 549 | 491 | 0,00 | 5,850 % éch. 25/08/2046 | 14 178 | 11 867 | 0,02 | 5,950 % éch. 25/04/2036 | 717 | 622 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/04/2037 | 3 513 | 3 201 | 0,01 | 5,862 % éch. 25/11/2046 | 5 612 | 4 683 | 0,01 | 6,190 % éch. 25/11/2035 | 114 | 108 | 0,00 |
| 5,970 % éch. 25/05/2037 | 3 826 | 3 085 | 0,01 | 5,870 % éch. 25/05/2036 | 3 454 | 2 972 | 0,01 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/07/2036 | 894 | 760 | 0,00 | 5,870 % éch. 25/12/2036 | 3 876 | 916 | 0,00 | 1,616 % éch. 20/01/2035 | 27 | 21 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/09/2036 | 190 | 167 | 0,00 | 5,870 % éch. 25/04/2037 | 2 043 | 711 | 0,00 | 1,730 % éch. 25/05/2036 (a) | 333 | 54 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/10/2036 | 201 | 170 | 0,00 | 5,890 % éch. 25/07/2046 | 5 333 | 4 596 | 0,01 | 3,164 % éch. 25/02/2035 | 1 904 | 1 540 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/11/2036 | 3 009 | 2 721 | 0,01 | 5,892 % éch. 20/03/2046 | 4 862 | 3 949 | 0,01 | 3,396 % éch. 25/05/2047 | 2 347 | 1 995 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/12/2036 | 1 538 | 1 245 | 0,00 | 5,892 % éch. 20/05/2035 | 15 260 | 12 869 | 0,02 | 3,695 % éch. 25/04/2036 | 1 677 | 1 156 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/01/2037 | 4 551 | 3 702 | 0,01 | 5,910 % éch. 25/09/2047 | 4 279 | 3 866 | 0,01 | 3,789 % éch. 25/04/2037 | 1 508 | 1 379 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/02/2037 | 1 429 | 1 165 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/03/2036 | 2 998 | 2 864 | 0,01 | 3,873 % éch. 20/05/2036 | 1 082 | 1 026 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/03/2037 | 2 491 | 2 078 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/11/2036 | 3 396 | 2 763 | 0,01 | 4,001 % éch. 20/06/2036 | 1 604 | 1 395 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/05/2037 | 396 | 342 | 0,00 | 5,932 % éch. 20/07/2035 | 1 554 | 1 438 | 0,00 | 4,039 % éch. 20/05/2036 | 1 078 | 974 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/06/2037 | 6 289 | 5 494 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/07/2035 | 1 274 | 1 004 | 0,00 | 4,042 % éch. 20/04/2036 | 1 044 | 930 | 0,00 |
| Commercial Mortgage Trust | | | | 5,950 % éch. 25/01/2035 | 3 124 | 2 549 | 0,00 | 4,110 % éch. 20/02/2036 | 2 191 | 1 929 | 0,00 |
| 0,000 % éch. 10/04/2047 (a) | 58 900 | 1 | 0,00 | 5,952 % éch. 25/06/2046 | 4 477 | 3 639 | 0,01 | 4,126 % éch. 20/09/2036 | 2 059 | 1 782 | 0,00 |
| 1,303 % éch. 10/10/2049 (a) | 66 181 | 1 663 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/07/2036 | 2 233 | 1 000 | 0,00 | 4,152 % éch. 20/03/2036 | 361 | 294 | 0,00 |
| 3,140 % éch. 10/10/2036 | 10 000 | 8 793 | 0,01 | 5,970 % éch. 25/09/2036 | 107 | 44 | 0,00 | 4,225 % éch. 25/03/2037 | 128 | 117 | 0,00 |
| 3,178 % éch. 10/02/2035 | 29 775 | 28 304 | 0,04 | 5,970 % éch. 25/05/2037 | 146 | 66 | 0,00 | 4,290 % éch. 25/11/2037 | 1 321 | 1 228 | 0,00 |
| 3,505 % éch. 10/08/2048 | 7 213 | 7 002 | 0,01 | 5,970 % éch. 25/05/2037 | 1 779 | 629 | 0,00 | 4,294 % éch. 25/11/2037 | 1 736 | 1 541 | 0,00 |
| 3,611 % éch. 10/08/2049 | 13 175 | 11 965 | 0,02 | 5,970 % éch. 25/06/2037 | 3 356 | 2 837 | 0,01 | 4,366 % éch. 19/01/2034 | 8 | 7 | 0,00 |
| 3,651 % éch. 10/02/2049 | 13 740 | 13 312 | 0,02 | 5,970 % éch. 25/09/2037 | 824 | 331 | 0,00 | 4,442 % éch. 20/12/2035 | 1 510 | 1 362 | 0,00 |
| 3,961 % éch. 10/05/2051 | 39 998 | 37 740 | 0,05 | 5,970 % éch. 25/07/2046 | 2 558 | 2 161 | 0,00 | 4,448 % éch. 20/06/2035 | 4 | 3 | 0,00 |
| 6,658 % éch. 15/09/2033 | 10 849 | 9 802 | 0,02 | 5,990 % éch. 25/07/2035 | 1 220 | 1 062 | 0,00 | 4,448 % éch. 20/06/2035 | 15 | 14 | 0,00 |
| Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust | | | | 5,990 % éch. 25/12/2035 | 1 010 | 887 | 0,00 | 4,541 % éch. 20/02/2036 | 657 | 581 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/05/2036 | 272 | 156 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/03/2027 | 19 | 18 | 0,00 | 4,723 % éch. 20/09/2035 | 1 279 | 1 148 | 0,00 |
| 6,250 % éch. 25/08/2037 | 1 176 | 584 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/10/2033 | 5 | 5 | 0,00 | 4,741 % éch. 20/07/2034 | 103 | 94 | 0,00 |
| 7,000 % éch. 25/01/2037 | 286 | 59 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/11/2034 | 3 412 | 3 403 | 0,01 | 4,765 % éch. 25/11/2034 | 32 | 28 | 0,00 |
| Countrywide Alternative Loan Trust | | | | 6,000 % éch. 25/12/2034 | 691 | 619 | 0,00 | 4,859 % éch. 25/01/2036 | 172 | 159 | 0,00 |
| 1,030 % éch. 25/09/2037 (a) | 824 | 125 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/02/2035 | 1 303 | 1 100 | 0,00 | 5,107 % éch. 20/10/2034 | 218 | 198 | 0,00 |
| 1,480 % éch. 25/10/2037 (a) | 1 546 | 261 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/08/2035 | 53 | 22 | 0,00 | 5,308 % éch. 20/04/2035 | 110 | 100 | 0,00 |
| 3,533 % éch. 25/05/2035 | 1 953 | 1 452 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/12/2035 | 3 752 | 2 769 | 0,01 | 5,377 % éch. 20/09/2035 | 73 | 62 | 0,00 |
| 3,713 % éch. 25/07/2021 | 3 | 3 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/01/2036 | 1 960 | 1 388 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/05/2035 | 556 | 456 | 0,00 |
| 3,810 % éch. 25/11/2035 | 6 226 | 5 787 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/02/2036 | 1 579 | 1 369 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/09/2035 | 403 | 362 | 0,00 |
| 3,913 % éch. 25/03/2047 | 629 | 562 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/03/2036 | 3 157 | 1 428 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/10/2035 | 863 | 500 | 0,00 |
| 4,282 % éch. 25/03/2047 | 669 | 594 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/04/2036 | 7 886 | 3 906 | 0,01 | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 1 741 | 1 093 | 0,00 |
| 4,297 % éch. 25/06/2037 | 6 211 | 5 419 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/05/2036 | 4 187 | 1 845 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/01/2036 | 603 | 386 | 0,00 |
| 4,394 % éch. 25/10/2035 | 162 | 130 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/08/2036 | 16 681 | 11 008 | 0,02 | 5,750 % éch. 25/12/2035 | 1 308 | 650 | 0,00 |
| 4,450 % éch. 25/04/2036 | 189 | 162 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/10/2036 | 4 632 | 2 562 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/02/2037 | 3 071 | 1 513 | 0,00 |
| 5,000 % éch. 25/08/2035 | 2 335 | 1 613 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/11/2036 | 8 344 | 4 871 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/06/2037 | 1 874 | 938 | 0,00 |
| 5,036 % éch. 25/09/2034 | 1 060 | 1 005 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/12/2036 | 2 126 | 655 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/05/2036 | 3 333 | 114 | 0,00 |
| 5,250 % éch. 25/06/2035 | 1 351 | 1 034 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/01/2037 | 1 236 | 730 | 0,00 | 5,771 % éch. 20/12/2035 | 21 | 20 | 0,00 |
| 5,250 % éch. 25/10/2035 | 209 | 146 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/02/2037 | 10 649 | 4 266 | 0,01 | 5,800 % éch. 25/02/2035 | 23 | 19 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/04/2035 | 2 317 | 1 937 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/03/2037 | 5 002 | 1 908 | 0,00 | 5,850 % éch. 25/05/2036 | 260 | 116 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/05/2035 | 5 269 | 4 127 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 6 753 | 3 769 | 0,01 | 5,870 % éch. 25/08/2035 | 2 284 | 1 645 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/06/2035 | 4 027 | 2 813 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 10 858 | 5 068 | 0,01 | 5,870 % éch. 25/09/2037 | 3 974 | 1 658 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/07/2035 | 1 831 | 1 454 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/07/2037 | 6 366 | 3 146 | 0,01 | 5,870 % éch. 25/04/2046 | 2 222 | 1 852 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/08/2035 | 2 756 | 2 191 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 18 089 | 9 392 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/03/2036 | 3 194 | 2 896 | 0,01 |
| 5,500 % éch. 25/09/2035 | 6 333 | 4 385 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/02/2047 | 2 135 | 1 071 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/04/2036 | 1 098 | 570 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/10/2035 | 682 | 405 | 0,00 | 6,010 % éch. 25/01/2036 | 2 305 | 2 044 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/05/2036 | 2 785 | 1 294 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/11/2035 | 3 275 | 2 003 | 0,00 | 6,010 % éch. 25/07/2036 | 2 647 | 2 274 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/07/2036 | 2 444 | 1 279 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/12/2035 | 9 825 | 7 133 | 0,01 | 6,012 % éch. 25/12/2035 | 946 | 832 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/02/2037 | 4 031 | 2 061 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/01/2036 | 866 | 616 | 0,00 | 6,012 % éch. 25/02/2036 | 135 | 122 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/03/2037 | 4 010 | 1 862 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/02/2036 | 6 090 | 4 086 | 0,01 | 6,030 % éch. 25/08/2035 | 2 855 | 2 609 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 2 666 | 1 315 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/04/2036 | 506 | 391 | 0,00 | 6,030 % éch. 25/02/2037 | 4 704 | 3 792 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 8 686 | 3 950 | 0,01 |
| 5,500 % éch. 25/04/2037 | 483 | 253 | 0,00 | 6,030 % éch. 25/10/2046 | 7 025 | 6 416 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/07/2037 | 1 112 | 482 | 0,00 |
| 5,652 % éch. 20/02/2047 | 5 098 | 3 930 | 0,01 | 6,030 % éch. 25/08/2047 | 5 366 | 4 425 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 3 412 | 1 526 | 0,00 |
| 5,662 % éch. 20/03/2047 | 5 900 | 4 832 | 0,01 | 6,050 % éch. 25/02/2036 | 1 089 | 962 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/10/2037 | 1 240 | 880 | 0,00 |
| 5,667 % éch. 20/12/2046 | 8 124 | 6 990 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/12/2035 | 1 697 | 1 279 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/01/2038 | 6 776 | 3 145 | 0,01 |
| 5,710 % éch. 25/06/2036 | 1 683 | 1 491 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/01/2036 | 1 357 | 1 191 | 0,00 | 6,050 % éch. 25/04/2035 | 1 064 | 973 | 0,00 |
| 5,710 % éch. 25/12/2046 | 641 | 551 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/10/2036 | 630 | 264 | 0,00 | 6,050 % éch. 25/04/2035 | 134 | 119 | 0,00 |
| 5,730 % éch. 25/03/2047 | 3 864 | 2 962 | 0,01 | 6,072 % éch. 20/11/2035 | 1 259 | 1 145 | 0,00 | 6,084 % éch. 25/08/2034 | 378 | 343 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/07/2035 | 118 | 74 | 0,00 | 6,090 % éch. 25/08/2035 | 1 329 | 1 174 | 0,00 | 6,090 % éch. 25/03/2035 | 1 137 | 965 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/10/2035 | 491 | 358 | 0,00 | 6,110 % éch. 25/11/2035 | 743 | 593 | 0,00 | 6,110 % éch. 25/03/2035 | 1 555 | 1 388 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/05/2036 | 8 920 | 3 507 | 0,01 | 6,112 % éch. 20/11/2035 | 7 729 | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,810 % éch. 25/06/2035 | \$ 42 | \$ 40 | 0,00 | Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust | \$ 601 | \$ 528 | 0,00 | Formentera Issuer PLC | £ 14 610 | \$ 18 453 | 0,03 |
| 5,890 % éch. 25/07/2036 | 305 | 280 | 0,00 | 4,448 % éch. 25/02/2036 | 366 | 240 | 0,00 | FWD Securitization Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/03/2035 | 275 | 264 | 0,00 | 4,500 % éch. 25/10/2035 | 1 967 | 1 727 | 0,00 | 2,240 % éch. 25/01/2050 | \$ 6 125 | 5 606 | 0,01 |
| Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc. | | | | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 664 | 653 | 0,00 | GC Pastor Hipotecario FTA | | | |
| 5,945 % éch. 27/11/2035 | 222 | 208 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 2 | 1 | 0,00 | 4,093 % éch. 21/06/2046 | € 1 231 | 1 190 | 0,00 |
| Countrywide, Inc. | | | | 5,500 % éch. 25/12/2035 | 629 | 507 | 0,00 | Glen Securities Finance DAC | | | |
| 5,693 % éch. 27/11/2035 | 0 | 0 | 0,00 | Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust | | | | 6,052 % éch. 28/10/2038 | 3 287 | 3 642 | 0,01 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | 6,005 % éch. 25/10/2036 | 1 240 | 1 043 | 0,00 | 7,052 % éch. 28/10/2038 | 2 484 | 2 719 | 0,01 |
| 4,186 % éch. 25/06/2046 | 21 367 | 20 591 | 0,03 | 6,445 % éch. 25/02/2036 | 3 524 | 3 087 | 0,01 | 7,852 % éch. 28/10/2038 | 1 187 | 1 282 | 0,00 |
| 5,000 % éch. 25/07/2035 | 554 | 510 | 0,00 | Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust | | | | Glenbeigh Issuer DAC | | | |
| 5,084 % éch. 25/03/2033 | 68 | 65 | 0,00 | 4,793 % éch. 19/10/2036 | 243 | 207 | 0,00 | 4,666 % éch. 24/03/2046 | 18 607 | 20 549 | 0,03 |
| 5,500 % éch. 25/07/2035 | 1 456 | 1 331 | 0,00 | 4,793 % éch. 25/06/2036 | 1 829 | 1 597 | 0,00 | 4,666 % éch. 24/06/2050 | 6 214 | 6 860 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/12/2035 | 1 869 | 835 | 0,00 | Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp. | | | | 4,916 % éch. 24/06/2050 | 15 867 | 17 373 | 0,03 |
| 6,500 % éch. 25/12/2035 | 426 | 210 | 0,00 | 6,500 % éch. 27/07/2037 | 493 | 383 | 0,00 | 5,716 % éch. 24/03/2046 | 2 593 | 2 850 | 0,01 |
| 7,000 % éch. 25/12/2035 | 1 296 | 255 | 0,00 | Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust | | | | GMAC Commercial Mortgage Asset Corp. | | | |
| 7,000 % éch. 25/01/2036 | 4 856 | 761 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/06/2034 | 179 | 180 | 0,00 | 5,456 % éch. 10/03/2051 | \$ 18 032 | 17 007 | 0,03 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates | | | | Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates | | | | 5,550 % éch. 10/08/2038 | 18 640 | 17 977 | 0,03 |
| 5,553 % éch. 25/07/2035 | 2 034 | 1 902 | 0,00 | 4,042 % éch. 27/06/2037 | 500 | 431 | 0,00 | GMAC Mortgage Corp. Loan Trust | | | |
| 6,053 % éch. 25/10/2033 | 5 | 5 | 0,00 | Dilosk RMBS DAC | | | | 3,357 % éch. 19/04/2036 | 298 | 231 | 0,00 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates | | | | 4,956 % éch. 20/10/2062 | € 6 963 | 7 724 | 0,01 | 3,637 % éch. 18/03/2035 | 15 | 12 | 0,00 |
| 2,139 % éch. 27/02/2046 | 6 636 | 3 476 | 0,01 | Domini BV | | | | 3,644 % éch. 19/11/2035 | 59 | 48 | 0,00 |
| 3,193 % éch. 30/11/2037 | 7 008 | 6 355 | 0,01 | 4,775 % éch. 15/06/2051 | 4 154 | 4 594 | 0,01 | 6,750 % éch. 19/07/2035 | 145 | 123 | 0,00 |
| 4,106 % éch. 27/07/2037 | 7 10 | 680 | 0,00 | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust | | | | Great Hall Mortgages PLC | | | |
| 4,337 % éch. 26/08/2036 | 4 172 | 3 634 | 0,01 | 5,660 % éch. 19/10/2036 | \$ 5 998 | 4 954 | 0,01 | 4,152 % éch. 18/03/2039 | € 1 500 | 1 590 | 0,00 |
| 4,448 % éch. 27/02/2036 | 2 475 | 1 694 | 0,00 | 5,670 % éch. 19/10/2036 | 3 846 | 2 634 | 0,00 | 4,462 % éch. 18/06/2039 | 1 960 | 1 933 | 0,00 |
| 4,592 % éch. 27/01/2036 | 2 887 | 2 730 | 0,01 | 6,050 % éch. 19/10/2045 | 3 137 | 2 656 | 0,00 | 5,132 % éch. 18/06/2039 | 8 800 | 8 724 | 0,01 |
| 4,679 % éch. 26/06/2036 | 3 256 | 2 835 | 0,01 | 6,210 % éch. 19/10/2045 | 2 800 | 2 585 | 0,00 | 5,469 % éch. 18/03/2039 | € 1 603 | 2 031 | 0,00 |
| 4,725 % éch. 27/07/2037 | 949 | 886 | 0,00 | 6,290 % éch. 19/09/2044 | 7 | 6 | 0,00 | 5,479 % éch. 18/06/2039 | 68 | 86 | 0,00 |
| 5,338 % éch. 27/11/2036 | 12 945 | 15 887 | 0,02 | Dutch Property Finance BV | | | | 5,489 % éch. 18/06/2038 | 800 | 1 019 | 0,00 |
| 5,620 % éch. 29/09/2036 | 246 | 238 | 0,00 | 4,602 % éch. 28/07/2054 | € 10 259 | 11 326 | 0,02 | 5,639 % éch. 18/06/2039 | 2 390 | 2 936 | 0,01 |
| 5,737 % éch. 27/10/2036 | 8 578 | 6 501 | 0,01 | 4,852 % éch. 28/04/2064 | 47 025 | 52 089 | 0,08 | 5,812 % éch. 18/06/2039 | \$ 136 | 135 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 26/12/2035 | 399 | 261 | 0,00 | Eurohome UK Mortgages PLC | | | | 6,119 % éch. 18/03/2039 | € 1 710 | 1 917 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/07/2037 | 793 | 668 | 0,00 | 5,490 % éch. 15/06/2044 | € 2 735 | 3 438 | 0,01 | 6,589 % éch. 18/06/2039 | 2 000 | 2 274 | 0,00 |
| 12,427 % éch. 27/11/2037 | 393 | 394 | 0,00 | 5,689 % éch. 15/09/2044 | 2 250 | 2 749 | 0,01 | GreenPoint Mortgage Funding Trust | | | |
| Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust | | | | 5,939 % éch. 15/09/2044 | 7 250 | 8 550 | 0,01 | 5,870 % éch. 25/10/2046 | \$ 6 678 | 6 038 | 0,01 |
| 5,500 % éch. 25/08/2036 | 1 132 | 809 | 0,00 | European Loan Conduit DAC | | | | 5,890 % éch. 25/04/2036 | 286 | 244 | 0,00 |
| 5,837 % éch. 25/04/2037 | 5 208 | 1 301 | 0,00 | 4,994 % éch. 17/02/2030 | € 64 025 | 69 805 | 0,10 | 5,910 % éch. 25/06/2045 | 576 | 544 | 0,00 |
| 5,942 % éch. 25/02/2037 | 1 030 | 248 | 0,00 | Eurosail PLC | | | | 5,990 % éch. 25/10/2045 | 2 849 | 2 790 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/10/2021 | 9 | 3 | 0,00 | 4,165 % éch. 15/12/2044 | 575 | 630 | 0,00 | 6,050 % éch. 25/02/2036 | 1 397 | 1 215 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/03/2036 | 4 013 | 1 737 | 0,00 | 4,198 % éch. 13/03/2045 | 5 105 | 5 548 | 0,01 | 6,090 % éch. 25/10/2045 | 2 381 | 2 173 | 0,00 |
| 6,396 % éch. 25/04/2036 | 268 | 143 | 0,00 | 4,219 % éch. 10/06/2044 | 762 | 839 | 0,00 | Grifonas Finance PLC | | | |
| 6,421 % éch. 25/10/2037 | 4 230 | 2 590 | 0,00 | 4,408 % éch. 13/03/2045 | 4 000 | 3 811 | 0,01 | 4,212 % éch. 28/08/2039 | € 16 670 | 17 980 | 0,03 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Trust | | | | 4,419 % éch. 10/09/2044 | 3 200 | 3 428 | 0,01 | GS Mortgage Securities Corp. Trust | | | |
| 2,318 % éch. 25/07/2057 | 3 499 | 2 732 | 0,01 | 5,489 % éch. 13/03/2045 | € 873 | 1 105 | 0,00 | 4,591 % éch. 10/10/2032 | \$ 35 288 | 32 291 | 0,05 |
| 2,443 % éch. 25/09/2048 | 12 592 | 9 990 | 0,02 | 5,789 % éch. 10/09/2044 | 1 200 | 1 485 | 0,00 | 6,609 % éch. 15/07/2035 | 11 979 | 9 057 | 0,01 |
| 2,500 % éch. 25/07/2057 | 55 973 | 49 643 | 0,07 | 6,109 % éch. 13/09/2045 | 11 715 | 14 276 | 0,02 | GS Mortgage Securities Corp. Trust | | | |
| 2,825 % éch. 25/12/2048 | 12 053 | 10 936 | 0,02 | 6,289 % éch. 13/06/2045 | 10 707 | 13 572 | 0,02 | 7,473 % éch. 15/07/2025 | 12 349 | 12 069 | 0,02 |
| 3,068 % éch. 25/02/2056 | 151 907 | 117 467 | 0,17 | 6,339 % éch. 13/06/2045 | 1 321 | 1 563 | 0,00 | 8,659 % éch. 15/11/2032 | 19 350 | 18 467 | 0,03 |
| 3,142 % éch. 25/07/2057 | 52 751 | 31 142 | 0,05 | Finsbury Square PLC | | | | GSC Capital Corp. Mortgage Trust | | | |
| 3,260 % éch. 25/07/2058 | 268 266 | 208 595 | 0,30 | 6,020 % éch. 16/12/2071 | 1 258 | 1 600 | 0,00 | 5,870 % éch. 25/02/2036 | 1 428 | 1 302 | 0,00 |
| 3,726 % éch. 25/10/2058 | 508 | 431 | 0,00 | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust | | | | GSMPs Mortgage Loan Trust | | | |
| 3,896 % éch. 25/09/2057 | 1 210 | 1 016 | 0,00 | 4,700 % éch. 25/09/2035 | \$ 153 | 127 | 0,00 | 3,849 % éch. 25/06/2034 | 4 012 | 3 665 | 0,01 |
| 4,000 % éch. 01/08/2057 | 5 786 | 5 429 | 0,01 | 5,148 % éch. 25/02/2037 | 390 | 221 | 0,00 | 5,820 % éch. 25/03/2035 | 5 821 | 5 126 | 0,01 |
| 4,089 % éch. 25/06/2048 | 45 151 | 39 492 | 0,06 | 5,207 % éch. 25/03/2035 | 446 | 268 | 0,00 | 5,820 % éch. 25/09/2035 | 6 695 | 5 645 | 0,01 |
| 4,278 % éch. 25/09/2057 | 28 617 | 24 146 | 0,04 | 5,249 % éch. 25/11/2035 | 1 438 | 901 | 0,00 | 5,870 % éch. 25/06/2034 | 1 283 | 1 132 | 0,00 |
| 4,509 % éch. 25/04/2058 | 48 960 | 44 238 | 0,06 | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 69 | 35 | 0,00 | 7,060 % éch. 20/10/2032 | 1 117 | 998 | 0,00 |
| 5,852 % éch. 01/06/2050 | 93 420 | 92 681 | 0,13 | 5,542 % éch. 25/02/2036 | 110 | 82 | 0,00 | GSMSC Resecuritization Trust | | | |
| 6,194 % éch. 15/07/2032 | 21 261 | 20 296 | 0,03 | 5,574 % éch. 25/01/2037 | 764 | 566 | 0,00 | 2,167 % éch. 26/04/2037 | 9 344 | 2 463 | 0,00 |
| 6,444 % éch. 15/07/2032 | 22 200 | 20 983 | 0,03 | 5,956 % éch. 25/11/2036 | 746 | 520 | 0,00 | 4,699 % éch. 26/08/2035 | 66 | 66 | 0,00 |
| 7,344 % éch. 15/07/2032 | 9 193 | 8 457 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/05/2036 | 673 | 288 | 0,00 | 5,637 % éch. 26/09/2036 | 7 859 | 5 033 | 0,01 |
| Curzon Mortgages PLC | | | | 6,000 % éch. 25/02/2037 | 742 | 303 | 0,00 | GSR Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,970 % éch. 28/07/2049 | £ 3 253 | 4 124 | 0,01 | 6,250 % éch. 25/11/2036 | 2 047 | 639 | 0,00 | 3,679 % éch. 25/05/2037 | 1 288 | 721 | 0,00 |
| DBUS Mortgage Trust | | | | First Horizon Asset Securities, Inc. | | | | 3,904 % éch. 25/04/2036 | 3 553 | 2 363 | 0,00 |
| 3,452 % éch. 10/10/2034 | \$ 2 000 | 1 837 | 0,00 | 4,846 % éch. 25/01/2036 | 28 | 16 | 0,00 | 4,285 % éch. 25/03/2047 | 5 583 | 3 573 | 0,01 |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust | | | | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust | | | | 4,315 % éch. 25/05/2037 | 2 434 | 2 195 | 0,00 |
| 5,610 % éch. 25/07/2047 | 9 040 | 8 307 | 0,01 | 4,022 % éch. 25/11/2036 | 333 | 210 | 0,00 | 4,630 % éch. 25/01/2036 | 725 | 661 | 0,00 |
| 5,670 % éch. 25/08/2047 | 2 773 | 2 533 | 0,00 | 4,510 % éch. 25/07/2037 | 234 | 149 | 0,00 | 4,649 % éch. 25/07/2035 | 45 | 41 | 0,00 |
| 5,710 % éch. 25/08/2036 | 477 | 436 | 0,00 | 5,673 % éch. 25/11/2037 | 279 | 216 | 0,00 | 5,349 % éch. 25/10/2035 | 84 | 77 | 0,00 |
| 5,730 % éch. 25/08/2047 | 5 171 | 4 577 | 0,01 | 5,806 % éch. 25/08/2037 | 236 | 79 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/09/2034 | 632 | 613 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/03/2037 | 5 742 | 5 133 | 0,01 | 5,967 % éch. 25/09/2035 | 5 | 5 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/07/2035 | 425 | 384 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/09/2047 | 10 963 | 9 331 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/05/2036 | 173 | 78 | 0,00 | 5,545 % éch. 25/05/2037 | 119 | 101 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/03/2037 | 13 345 | 6 824 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 247 | 101 | 0,00 | 5,700 % éch. 25/05/2037 | 11 934 | 5 892 | 0,01 |
| 5,800 % éch. 25/08/2037 | 11 824 | 9 361 | 0,01 | Fondo de Titulización de Activos UCI | | | | 5,750 % éch. 25/03/2036 | 226 | 194 | 0,00 |
| 5,830 % éch. 25/01/2047 | 1 932 | 1 707 | 0,00 | 4,082 % éch. 16/06/2049 | € 9 363 | 10 086 | 0,02 | 5,750 % éch. 25/05/2037 | 113 | 290 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/10/2036 | 15 556 | 4 516 | 0,01 | | | | | 5,820 % éch. 25/06/2035 | 1 803 | 1 692 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/12/2036 | 1 910 | 618 | 0,00 | | | | | 5,910 % éch. 25/08/2046 | 18 042 | 4 247 | 0,01 |
| 5,850 % éch. 25/02/2037 | 2 289 | 1 958 | 0,00 | | | | | 5,990 % éch. 25/08/2046 | 15 076 | 3 883 | 0,01 |
| 5,850 % éch. 25/08/2047 | 5 545 | 4 903 | 0,01 | | | | | 6,000 % éch. 25/11/2035 | 2 353 | 938 | 0,00 |
| 5,950 % éch. 25/01/2047 | 2 559 | 2 169 | 0,00 | | | | | 6,000 % éch. 25/02/2036 | 1 775 | 877 | 0,00 |
| 6,030 % éch. 25/08/2036 | 3 210 | 2 888 | 0,01 | | | | | | | | |
| 6,110 % éch. 25/08/2047 | 5 577 | 3 857 | 0,01 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 6,000 % éch. 25/07/2036 | \$ 1 866 | \$ 1 082 | 0,00 | IndyMac Mortgage Loan Trust | | | | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust | \$ 813 | \$ 0 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/07/2037 | 451 | 285 | 0,00 | 3,088 % éch. 25/06/2037 | \$ 2 949 | \$ 2 522 | 0,00 | 0,945 % éch. 15/04/2046 (a) | 11 700 | 10 818 | 0,02 |
| 6,250 % éch. 25/08/2036 | 2 170 | 744 | 0,00 | 3,112 % éch. 25/06/2037 | 1 731 | 1 478 | 0,00 | 2,854 % éch. 06/09/2038 | 32 860 | 29 483 | 0,04 |
| 6,500 % éch. 25/05/2036 | 907 | 320 | 0,00 | 3,278 % éch. 25/05/2037 | 1 479 | 1 159 | 0,00 | 4,128 % éch. 05/07/2031 | 10 000 | 8 806 | 0,01 |
| 6,870 % éch. 25/05/2034 | 15 | 12 | 0,00 | 3,284 % éch. 25/07/2037 | 6 629 | 5 880 | 0,01 | 4,248 % éch. 05/07/2033 | 3 839 | 3 174 | 0,01 |
| HarborView Mortgage Loan Trust | | | | 3,323 % éch. 25/08/2037 | 4 623 | 3 460 | 0,01 | 4,549 % éch. 05/07/2033 | 38 900 | 30 305 | 0,04 |
| 4,209 % éch. 19/07/2035 | 18 | 13 | 0,00 | 3,342 % éch. 25/04/2037 | 3 622 | 3 216 | 0,01 | 4,950 % éch. 05/07/2033 | 999 | 961 | 0,00 |
| 4,232 % éch. 19/06/2036 | 2 105 | 1 041 | 0,00 | 3,355 % éch. 25/06/2036 | 5 429 | 3 490 | 0,01 | 5,337 % éch. 15/05/2047 | 9 940 | 7 270 | 0,01 |
| 5,265 % éch. 19/11/2034 | 320 | 291 | 0,00 | 3,536 % éch. 25/03/2037 | 307 | 236 | 0,00 | 5,350 % éch. 05/07/2033 | 17 100 | 13 217 | 0,02 |
| 5,650 % éch. 19/11/2046 | 823 | 567 | 0,00 | 3,536 % éch. 25/04/2037 | 6 741 | 6 094 | 0,01 | 6,826 % éch. 15/12/2036 | 2 184 | 2 147 | 0,00 |
| 5,660 % éch. 19/09/2037 | 8 452 | 7 184 | 0,01 | 3,551 % éch. 25/03/2036 | 3 292 | 2 390 | 0,00 | 7,026 % éch. 15/02/2035 | 10 109 | 8 446 | 0,01 |
| 5,720 % éch. 25/02/2036 | 147 | 39 | 0,00 | 3,599 % éch. 25/05/2037 | 1 954 | 1 309 | 0,00 | 7,485 % éch. 05/07/2033 | | | |
| 5,730 % éch. 19/03/2037 | 5 929 | 5 269 | 0,01 | 3,601 % éch. 25/08/2037 | 2 700 | 1 965 | 0,00 | JPMorgan Mortgage Trust | | | |
| 5,770 % éch. 25/01/2047 | 11 120 | 9 921 | 0,02 | 3,636 % éch. 25/05/2036 | 151 | 132 | 0,00 | 3,750 % éch. 27/07/2037 | 424 | 390 | 0,00 |
| 5,780 % éch. 19/09/2035 | 8 543 | 4 523 | 0,01 | 3,671 % éch. 25/08/2036 | 155 | 123 | 0,00 | 4,009 % éch. 05/07/2036 | 1 252 | 1 015 | 0,00 |
| 5,806 % éch. 19/11/2036 | 15 416 | 13 480 | 0,02 | 3,674 % éch. 25/08/2035 | 60 | 43 | 0,00 | 4,032 % éch. 25/05/2036 | 37 | 32 | 0,00 |
| 5,810 % éch. 19/12/2036 | 494 | 463 | 0,00 | 3,822 % éch. 25/07/2036 | 3 340 | 2 358 | 0,00 | 4,153 % éch. 25/04/2037 | 3 | 2 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 19/01/2038 | 8 131 | 7 124 | 0,01 | 3,916 % éch. 25/09/2036 | 81 | 70 | 0,00 | 4,189 % éch. 25/05/2037 | 1 296 | 1 125 | 0,00 |
| 5,862 % éch. 19/12/2036 | 1 867 | 1 575 | 0,00 | 3,940 % éch. 25/06/2037 | 6 191 | 3 690 | 0,01 | 4,218 % éch. 25/04/2036 | 2 768 | 2 410 | 0,00 |
| 5,880 % éch. 19/12/2036 | 34 251 | 27 366 | 0,04 | 3,951 % éch. 25/11/2035 | 34 | 24 | 0,00 | 4,251 % éch. 25/05/2037 | 349 | 302 | 0,00 |
| 5,890 % éch. 19/11/2036 | 12 709 | 10 953 | 0,02 | 4,010 % éch. 25/05/2035 | 51 | 37 | 0,00 | 4,362 % éch. 25/01/2037 | 1 281 | 1 045 | 0,00 |
| 5,910 % éch. 19/05/2035 | 3 002 | 2 723 | 0,01 | 4,118 % éch. 25/09/2035 | 279 | 188 | 0,00 | 4,396 % éch. 25/05/2036 | 2 560 | 2 247 | 0,00 |
| 5,927 % éch. 19/12/2035 | 490 | 465 | 0,00 | 4,245 % éch. 25/01/2037 | 156 | 131 | 0,00 | 4,399 % éch. 25/08/2036 | 3 362 | 2 747 | 0,01 |
| 5,970 % éch. 19/01/2036 | 3 122 | 1 885 | 0,00 | 4,246 % éch. 25/09/2036 | 124 | 107 | 0,00 | 4,406 % éch. 25/10/2036 | 192 | 140 | 0,00 |
| 6,010 % éch. 19/03/2035 | 580 | 569 | 0,00 | 4,265 % éch. 25/12/2035 | 3 270 | 2 467 | 0,00 | 4,522 % éch. 25/08/2036 | 95 | 68 | 0,00 |
| 6,032 % éch. 20/10/2045 | 3 597 | 2 232 | 0,00 | 4,270 % éch. 25/09/2035 | 44 | 38 | 0,00 | 4,688 % éch. 25/10/2037 | 2 230 | 1 806 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 19/04/2034 | 58 | 51 | 0,00 | 4,353 % éch. 25/11/2035 | 1 413 | 1 141 | 0,00 | 4,769 % éch. 25/08/2035 | 182 | 156 | 0,00 |
| 6,090 % éch. 19/11/2035 | 155 | 105 | 0,00 | 4,435 % éch. 25/09/2036 | 1 356 | 922 | 0,00 | 4,879 % éch. 25/11/2035 | 1 677 | 1 376 | 0,00 |
| 6,110 % éch. 19/08/2045 | 2 360 | 1 801 | 0,00 | 4,598 % éch. 25/09/2037 | 11 839 | 8 783 | 0,01 | 5,057 % éch. 25/11/2035 | 3 114 | 2 552 | 0,00 |
| 6,150 % éch. 19/01/2035 | 150 | 141 | 0,00 | 4,727 % éch. 25/08/2034 | 66 | 60 | 0,00 | 5,111 % éch. 25/07/2035 | 248 | 223 | 0,00 |
| 6,188 % éch. 19/07/2045 | 18 | 16 | 0,00 | 5,630 % éch. 25/04/2037 | 921 | 830 | 0,00 | 5,168 % éch. 25/04/2035 | 293 | 266 | 0,00 |
| 6,470 % éch. 25/10/2037 | 11 358 | 10 445 | 0,02 | 5,660 % éch. 25/04/2037 | 1 550 | 1 395 | 0,00 | 5,201 % éch. 25/06/2034 | 8 | 8 | 0,00 |
| 6,512 % éch. 19/09/2035 | 98 | 83 | 0,00 | 5,680 % éch. 25/02/2046 | 4 781 | 3 394 | 0,01 | 5,309 % éch. 25/08/2035 | 541 | 538 | 0,00 |
| 6,822 % éch. 20/06/2035 | 846 | 732 | 0,00 | 5,680 % éch. 25/04/2046 | 2 572 | 2 117 | 0,00 | 5,484 % éch. 25/09/2035 | 345 | 313 | 0,00 |
| 7,010 % éch. 19/02/2036 | 1 808 | 939 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/04/2046 | 2 420 | 1 992 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/07/2036 | 2 870 | 1 453 | 0,00 |
| 7,12 % éch. 19/10/2035 | 6 524 | 3 708 | 0,01 | 5,710 % éch. 25/07/2036 | 4 364 | 4 280 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/01/2036 | 983 | 458 | 0,00 |
| 7,012 % éch. 19/01/2036 | 951 | 395 | 0,00 | 5,720 % éch. 25/09/2037 | 4 137 | 3 864 | 0,01 | 5,822 % éch. 25/08/2035 | 6 | 6 | 0,00 |
| Harbour Energy PLC | | | | 5,730 % éch. 25/10/2036 | 2 440 | 2 170 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 16 928 | 8 277 | 0,01 |
| 6,020 % éch. 28/01/2054 | £ 18 123 | 23 105 | 0,03 | 5,810 % éch. 25/01/2037 | 7 583 | 6 785 | 0,01 | 6,250 % éch. 25/08/2037 | 5 078 | 1 561 | 0,00 |
| 6,120 % éch. 28/01/2054 | 21 500 | 27 226 | 0,04 | 5,820 % éch. 25/06/2036 | 2 755 | 2 255 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/01/2035 | 1 283 | 1 293 | 0,00 |
| Hilton Orlando Trust | | | | 5,830 % éch. 25/08/2036 | 7 918 | 5 508 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/07/2036 | 2 217 | 86 | 0,00 |
| 9,309 % éch. 15/12/2034 | \$ 2 213 | 2 147 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/02/2037 | 5 565 | 5 131 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/08/2036 | 4 328 | 1 480 | 0,00 |
| Hilton USA Trust | | | | 5,830 % éch. 25/07/2047 | 3 306 | 2 254 | 0,00 | JPMorgan Resecuritization Trust | | | |
| 2,828 % éch. 05/11/2035 | 9 623 | 7 733 | 0,01 | 5,850 % éch. 25/10/2036 | 4 922 | 2 044 | 0,00 | 4,500 % éch. 26/04/2037 | 1 376 | 650 | 0,00 |
| Hipocat FTA | | | | 5,870 % éch. 25/06/2046 | 5 340 | 4 142 | 0,01 | 5,250 % éch. 26/09/2036 | 241 | 214 | 0,00 |
| 4,109 % éch. 24/10/2039 | € 1 270 | 1 396 | 0,00 | 5,870 % éch. 25/11/2046 | 6 084 | 5 526 | 0,01 | 5,559 % éch. 26/09/2037 | 1 239 | 913 | 0,00 |
| HomeBanc Mortgage Trust | | | | 5,890 % éch. 25/11/2036 | 298 | 270 | 0,00 | 5,750 % éch. 26/05/2037 | 127 | 55 | 0,00 |
| 3,815 % éch. 25/04/2037 | \$ 464 | 411 | 0,00 | 5,890 % éch. 25/05/2046 | 7 102 | 6 226 | 0,01 | 6,000 % éch. 26/09/2036 | 500 | 369 | 0,00 |
| 4,344 % éch. 25/04/2047 | 988 | 884 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/04/2035 | 251 | 225 | 0,00 | Jupiter Mortgage PLC | | | |
| 5,990 % éch. 25/01/2036 | 470 | 445 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/11/2036 | 3 505 | 3 472 | 0,01 | 6,621 % éch. 20/07/2060 | £ 5 900 | 7 520 | 0,01 |
| 6,205 % éch. 25/01/2036 | 6 736 | 5 796 | 0,01 | 5,990 % éch. 25/07/2035 | 5 658 | 3 709 | 0,01 | 6,921 % éch. 20/07/2060 | 4 233 | 5 392 | 0,01 |
| 6,210 % éch. 25/12/2034 | 54 | 50 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/07/2037 | 681 | 483 | 0,00 | 7,121 % éch. 20/07/2060 | 2 250 | 2 865 | 0,01 |
| Hops Hill PLC | | | | 6,000 % éch. 25/08/2037 | 943 | 363 | 0,00 | Kinbane DAC | | | |
| 6,148 % éch. 27/05/2054 | £ 24 765 | 31 587 | 0,05 | 6,010 % éch. 25/10/2036 | 2 005 | 840 | 0,00 | 4,685 % éch. 25/09/2062 | € 39 396 | 43 135 | 0,06 |
| HSI Asset Loan Obligation Trust | | | | 6,050 % éch. 25/01/2036 | 2 961 | 2 037 | 0,00 | Kirkby RMBS PLC | | | |
| 1,160 % éch. 25/12/2036 (a) | \$ 1 489 | 150 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/07/2035 | 1 058 | 848 | 0,00 | 0,000 % éch. 22/02/2045 | £ 1 | 2 341 | 0,00 |
| 5,840 % éch. 25/12/2036 | 1 910 | 442 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/11/2035 | 43 | 26 | 0,00 | 2,250 % éch. 22/02/2045 | 4 258 | 2 967 | 0,01 |
| Impac CMB Trust | | | | 6,250 % éch. 25/12/2034 | 695 | 540 | 0,00 | 6,140 % éch. 22/02/2045 | 24 167 | 30 430 | 0,04 |
| 6,010 % éch. 25/05/2035 | 157 | 144 | 0,00 | 6,270 % éch. 25/07/2046 | 4 658 | 4 062 | 0,01 | 7,340 % éch. 22/02/2045 | 13 150 | 16 007 | 0,02 |
| 6,060 % éch. 25/10/2034 | 321 | 328 | 0,00 | 6,290 % éch. 25/11/2034 | 954 | 814 | 0,00 | Landmark Mortgage Securities PLC | | | |
| 6,100 % éch. 25/02/2036 | 1 447 | 1 151 | 0,00 | 6,330 % éch. 25/09/2034 | 41 | 35 | 0,00 | 5,539 % éch. 17/06/2039 | 7 275 | 9 024 | 0,01 |
| 6,110 % éch. 25/11/2034 | 1 088 | 1 051 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/07/2037 | 371 | 118 | 0,00 | 6,140 % éch. 17/04/2044 | 8 336 | 10 078 | 0,02 |
| 6,110 % éch. 25/03/2035 | 2 349 | 2 079 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/09/2037 | 1 786 | 1 043 | 0,00 | Lanebrook Mortgage Transaction PLC | | | |
| 6,150 % éch. 25/01/2035 | 1 867 | 1 758 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/10/2037 | 2 709 | 1 421 | 0,00 | 6,320 % éch. 12/06/2057 | 11 473 | 14 662 | 0,02 |
| Impac Secured Assets CMN Owner Trust | | | | JPMorgan Alternative Loan Trust | | | | Lansdowne Mortgage Securities PLC | | | |
| 5,450 % éch. 25/03/2033 | 200 | 194 | 0,00 | 3,930 % éch. 25/03/2036 | 648 | 499 | 0,00 | 4,225 % éch. 15/06/2045 | € 2 720 | 2 848 | 0,01 |
| Impac Secured Assets Corp. | | | | 3,930 % éch. 25/10/2036 | 4 067 | 3 505 | 0,01 | Legacy Mortgage Asset Trust | | | |
| 6,110 % éch. 25/03/2036 | 1 227 | 992 | 0,00 | 4,127 % éch. 25/03/2037 | 895 | 812 | 0,00 | 0,000 % éch. 25/12/2056 (a) | \$ 114 375 | 806 | 0,00 |
| 6,895 % éch. 25/02/2035 | 255 | 255 | 0,00 | 4,412 % éch. 25/01/2036 | 342 | 223 | 0,00 | 0,125 % éch. 26/12/2057 (a) | 66 813 | 318 | 0,00 |
| Impac Secured Assets Trust | | | | 5,790 % éch. 25/07/2036 | 2 611 | 2 292 | 0,00 | 0,442 % éch. 26/12/2057 (a) | 18 050 | 186 | 0,00 |
| 5,690 % éch. 25/05/2037 | 522 | 421 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/05/2036 | 2 647 | 2 078 | 0,00 | 2,190 % éch. 25/02/2058 | 1 575 | 1 082 | 0,00 |
| 5,870 % éch. 25/11/2036 | 159 | 155 | 0,00 | 5,843 % éch. 26/05/2037 | 2 601 | 1 949 | 0,00 | 2,997 % éch. 25/12/2056 | 114 375 | 89 536 | 0,13 |
| 5,950 % éch. 25/03/2037 | 4 078 | 3 425 | 0,01 | 6,000 % éch. 27/12/2036 | 1 085 | 577 | 0,00 | 3,224 % éch. 26/08/2058 | 17 864 | 13 104 | 0,02 |
| 5,950 % éch. 25/09/2037 | 2 529 | 2 168 | 0,00 | 6,030 % éch. 25/06/2037 | 17 650 | 6 927 | 0,01 | 3,692 % éch. 26/12/2057 | 48 438 | 37 970 | 0,06 |
| 5,990 % éch. 25/01/2037 | 8 213 | 6 778 | 0,01 | 6,030 % éch. 25/04/2047 | 3 171 | 3 011 | 0,01 | 4, | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Lehman Mortgage Trust | | | | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | New Century Home Equity Loan Trust | | | |
| 5,750 % éch. 25/01/2037 | \$ 299 | \$ 175 | 0,00 | 0,187 % éch. 25/01/2029 (a) | \$ 461 | \$ 2 | 0,00 | 3,750 % éch. 25/08/2055 | \$ 4 305 | \$ 4 065 | 0,01 |
| 5,970 % éch. 25/07/2037 | 319 | 262 | 0,00 | 4,347 % éch. 25/05/2036 | 3 | 3 | 0,00 | New Residential Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/01/2036 | 2 406 | 538 | 0,00 | 5,303 % éch. 25/11/2035 | 80 | 74 | 0,00 | 4,000 % éch. 25/04/2057 | 6 790 | 6 451 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/07/2036 | 661 | 340 | 0,00 | 5,630 % éch. 25/12/2035 | 21 | 19 | 0,00 | 4,500 % éch. 25/05/2058 | 15 112 | 14 637 | 0,02 |
| 6,000 % éch. 25/12/2036 | 1 092 | 891 | 0,00 | 5,630 % éch. 25/12/2035 | 1 699 | 1 593 | 0,00 | Newgate Funding PLC | | | |
| 6,370 % éch. 25/12/2035 | 592 | 356 | 0,00 | 5,808 % éch. 25/01/2037 | 30 | 29 | 0,00 | 4,138 % éch. 01/12/2050 | € 4 323 | 4 612 | 0,01 |
| Lehman XS Trust | | | | 5,829 % éch. 25/12/2034 | 132 | 124 | 0,00 | 4,195 % éch. 01/12/2050 | 1 245 | 1 233 | 0,00 |
| 5,710 % éch. 25/08/2036 | 50 | 50 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/04/2029 | 384 | 358 | 0,00 | 4,525 % éch. 15/12/2050 | 10 765 | 11 661 | 0,02 |
| 5,740 % éch. 25/02/2036 | 304 | 269 | 0,00 | 6,130 % éch. 25/06/2028 | 0 | 0 | 0,00 | 5,500 % éch. 15/12/2050 | € 8 499 | 10 412 | 0,02 |
| 5,770 % éch. 25/11/2035 | 3 312 | 3 255 | 0,01 | 6,130 % éch. 25/09/2029 | 11 | 10 | 0,00 | 5,509 % éch. 01/12/2050 | 23 861 | 29 324 | 0,04 |
| 5,850 % éch. 25/12/2036 | 5 442 | 4 132 | 0,01 | 6,146 % éch. 25/01/2037 | 0 | 0 | 0,00 | 5,510 % éch. 01/12/2050 | 3 198 | 3 909 | 0,01 |
| 5,850 % éch. 25/09/2046 | 118 | 99 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/08/2035 | 2 952 | 2 798 | 0,01 | 6,340 % éch. 15/12/2050 | 2 458 | 3 017 | 0,01 |
| 5,870 % éch. 25/08/2046 | 3 924 | 3 584 | 0,01 | 6,295 % éch. 25/11/2029 | 544 | 471 | 0,00 | 6,590 % éch. 15/12/2050 | 392 | 465 | 0,00 |
| 5,870 % éch. 25/12/2046 | 725 | 669 | 0,00 | 6,415 % éch. 25/08/2036 | 1 814 | 1 610 | 0,00 | Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust | | | |
| 5,870 % éch. 25/03/2047 | 14 220 | 12 141 | 0,02 | 6,485 % éch. 25/01/2029 | 35 | 33 | 0,00 | 4,863 % éch. 25/06/2036 | \$ 262 | 193 | 0,00 |
| 5,870 % éch. 25/06/2047 | 5 393 | 4 392 | 0,01 | 6,606 % éch. 25/09/2029 | 95 | 88 | 0,00 | 5,034 % éch. 25/05/2035 | 1 571 | 807 | 0,00 |
| 5,880 % éch. 25/08/2046 | 7 888 | 7 111 | 0,01 | 7,299 % éch. 25/12/2032 | 6 | 6 | 0,00 | 5,688 % éch. 25/07/2035 | 389 | 371 | 0,00 |
| 5,890 % éch. 25/11/2046 | 12 716 | 11 727 | 0,02 | Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust | | | | 5,970 % éch. 25/06/2037 | 588 | 470 | 0,00 |
| 5,910 % éch. 25/06/2047 | 5 324 | 4 732 | 0,01 | 7,520 % éch. 25/08/2036 | 1 481 | 1 299 | 0,00 | 5,990 % éch. 25/12/2035 | 766 | 201 | 0,00 |
| 5,970 % éch. 25/08/2037 | 2 679 | 2 471 | 0,00 | Metlife Securitization Trust | | | | 6,169 % éch. 25/03/2047 | 777 | 695 | 0,00 |
| 5,990 % éch. 25/02/2046 | 8 458 | 7 480 | 0,01 | 3,750 % éch. 25/03/2057 | 4 734 | 4 525 | 0,01 | 6,408 % éch. 25/05/2036 | 722 | 141 | 0,00 |
| 6,012 % éch. 25/11/2035 | 72 | 69 | 0,00 | Miravet SARL | | | | 6,470 % éch. 25/05/2035 | 1 162 | 910 | 0,00 |
| 6,370 % éch. 25/08/2047 | 9 264 | 7 680 | 0,01 | 4,706 % éch. 26/05/2065 | € 3 609 | 3 950 | 0,01 | 6,490 % éch. 25/08/2034 | 290 | 274 | 0,00 |
| 6,512 % éch. 25/03/2047 | 2 797 | 2 401 | 0,00 | 4,806 % éch. 26/05/2065 | 32 260 | 35 346 | 0,05 | 6,495 % éch. 25/03/2047 | 1 429 | 1 278 | 0,00 |
| 7,170 % éch. 25/09/2047 | 1 371 | 1 196 | 0,00 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust | | | | 7,341 % éch. 25/02/2036 | 32 | 26 | 0,00 |
| London Wall Mortgage Capital PLC | | | | 0,812 % éch. 15/02/2047 (a) | \$ 134 | 0 | 0,00 | Nomura Resecuritization Trust | | | |
| 6,020 % éch. 15/05/2052 | £ 7 342 | 9 317 | 0,01 | 3,046 % éch. 15/04/2048 | 40 000 | 38 771 | 0,06 | 1,634 % éch. 26/03/2037 | 2 296 | 1 893 | 0,00 |
| Ludgate Funding PLC | | | | Morgan Stanley Capital Trust | | | | 6,370 % éch. 25/07/2036 | 19 953 | 19 076 | 0,03 |
| 4,115 % éch. 01/01/2061 | € 2 666 | 2 835 | 0,01 | 6,259 % éch. 15/08/2033 | 7 568 | 6 328 | 0,01 | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | |
| 4,195 % éch. 01/01/2061 | 730 | 731 | 0,00 | 7,609 % éch. 15/07/2035 | 34 709 | 33 966 | 0,05 | 0,523 % éch. 25/09/2046 | 10 181 | 3 572 | 0,01 |
| 4,265 % éch. 01/12/2060 | 1 658 | 1 603 | 0,00 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | OBX Trust | | | |
| 4,265 % éch. 01/01/2061 | 2 432 | 2 414 | 0,00 | 2,194 % éch. 25/06/2037 | 3 689 | 1 831 | 0,00 | 6,120 % éch. 25/06/2057 | 1 670 | 1 596 | 0,00 |
| 4,655 % éch. 01/01/2061 | 10 336 | 11 001 | 0,02 | 3,253 % éch. 25/11/2037 | 91 | 56 | 0,00 | 6,320 % éch. 25/04/2048 | 316 | 315 | 0,00 |
| 5,539 % éch. 01/12/2060 | £ 876 | 1 077 | 0,00 | 3,278 % éch. 25/11/2037 | 6 447 | 4 291 | 0,01 | Paragon Mortgages PLC | | | |
| 5,649 % éch. 01/12/2060 | 2 163 | 2 425 | 0,00 | 4,189 % éch. 25/10/2037 | 652 | 437 | 0,00 | 6,270 % éch. 15/05/2045 | £ 3 516 | 4 488 | 0,01 |
| 5,654 % éch. 01/01/2061 | 5 350 | 6 196 | 0,01 | 4,521 % éch. 25/05/2036 | 1 657 | 911 | 0,00 | Pepper Residential Securities Trust | | | |
| 6,014 % éch. 01/01/2061 | 3 239 | 3 991 | 0,01 | 4,768 % éch. 25/03/2036 | 37 | 23 | 0,00 | 6,380 % éch. 18/11/2060 | \$ 388 | 388 | 0,00 |
| Luminent Mortgage Trust | | | | 5,245 % éch. 25/08/2034 | 24 | 22 | 0,00 | PHH Alternative Mortgage Trust | | | |
| 5,750 % éch. 25/01/2037 | \$ 2 221 | 1 823 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/10/2037 | 306 | 287 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/02/2037 | 4 026 | 2 977 | 0,01 |
| 5,810 % éch. 25/12/2036 | 2 715 | 2 339 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/02/2036 | 459 | 405 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/05/2037 | 1 758 | 1 610 | 0,00 |
| 5,830 % éch. 25/12/2036 | 92 | 84 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/06/2036 | 3 586 | 748 | 0,00 | 6,170 % éch. 25/07/2037 | 823 | 785 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/05/2046 | 835 | 688 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/08/2036 | 5 772 | 1 464 | 0,00 | Pierpont BTL PLC | | | |
| 5,870 % éch. 25/02/2046 | 1 728 | 1 288 | 0,00 | 5,980 % éch. 25/02/2047 | 7 126 | 2 858 | 0,01 | 6,320 % éch. 21/09/2054 | £ 9 376 | 11 980 | 0,02 |
| Madison Avenue Mortgage Trust | | | | 6,000 % éch. 25/12/2035 | 2 597 | 1 045 | 0,00 | Polaris PLC | | | |
| 3,188 % éch. 15/08/2034 | 8 074 | 7 262 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/08/2036 | 3 313 | 1 843 | 0,00 | 5,985 % éch. 23/12/2058 | 2 540 | 3 231 | 0,01 |
| Mansard Mortgages PLC | | | | 6,000 % éch. 25/10/2037 | 10 720 | 5 660 | 0,01 | 7,845 % éch. 23/05/2059 | 2 768 | 3 562 | 0,01 |
| 5,520 % éch. 15/04/2047 | £ 1 837 | 2 278 | 0,00 | 6,354 % éch. 25/08/2036 | 1 264 | 241 | 0,00 | Precise Mortgage Funding PLC | | | |
| 6,589 % éch. 15/12/2049 | 2 930 | 3 637 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/02/2036 | 100 | 45 | 0,00 | 0,000 % éch. 12/12/2055 (f) | 0 | 1 337 | 0,00 |
| 7,339 % éch. 15/12/2049 | 2 604 | 3 209 | 0,01 | 6,595 % éch. 25/09/2035 | 2 124 | 2 059 | 0,00 | 6,126 % éch. 16/10/2056 | 7 470 | 9 521 | 0,01 |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust | | | | 7,035 % éch. 25/06/2036 | 1 028 | 1 014 | 0,00 | 6,646 % éch. 16/10/2056 | 1 200 | 1 524 | 0,00 |
| 3,227 % éch. 25/02/2035 | \$ 156 | 126 | 0,00 | 7,195 % éch. 25/11/2035 | 1 855 | 1 796 | 0,00 | 6,896 % éch. 16/10/2056 | 1 000 | 1 270 | 0,00 |
| 3,597 % éch. 25/03/2035 | 467 | 393 | 0,00 | 7,450 % éch. 25/09/2035 | 1 029 | 1 004 | 0,00 | 7,146 % éch. 16/10/2056 | 1 000 | 1 269 | 0,00 |
| 3,989 % éch. 25/03/2035 | 86 | 75 | 0,00 | Morgan Stanley Re-REMIC Trust | | | | 8,296 % éch. 16/10/2056 | 1 000 | 1 261 | 0,00 |
| 4,612 % éch. 25/03/2035 | 49 | 39 | 0,00 | 3,918 % éch. 26/12/2036 | 2 378 | 2 018 | 0,00 | Prime Mortgage Trust | | | |
| 5,412 % éch. 25/09/2034 | 805 | 715 | 0,00 | Morgan Stanley Resecuritization Trust | | | | 6,000 % éch. 25/06/2036 | \$ 9 | 8 | 0,00 |
| 5,862 % éch. 25/12/2046 | 8 987 | 8 153 | 0,01 | 4,080 % éch. 26/11/2046 | 2 980 | 2 506 | 0,00 | Primrose Residential DAC | | | |
| 6,570 % éch. 25/09/2037 | 7 382 | 3 239 | 0,01 | 4,209 % éch. 26/06/2047 | 5 501 | 4 182 | 0,01 | 4,626 % éch. 24/03/2061 | € 3 538 | 3 897 | 0,01 |
| 7,678 % éch. 25/12/2035 | 784 | 770 | 0,00 | Mortgage Equity Conversion Asset Trust | | | | 4,876 % éch. 24/10/2061 | 29 843 | 32 781 | 0,05 |
| MASTR Alternative Loan Trust | | | | 5,290 % éch. 25/02/2042 | 3 611 | 3 531 | 0,01 | Proteus RMBS DAC | | | |
| 5,500 % éch. 25/04/2035 | 2 280 | 2 089 | 0,00 | Mortgage Funding PLC | | | | 0,000 % éch. 29/10/2054 (b)(f) | 13 990 | 11 476 | 0,02 |
| 5,750 % éch. 25/08/2035 | 1 331 | 683 | 0,00 | 6,439 % éch. 13/03/2046 | £ 10 212 | 12 983 | 0,02 | 0,000 % éch. 29/10/2054 | 200 | 0 | 0,00 |
| 6,500 % éch. 25/05/2034 | 61 | 59 | 0,00 | MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | | 4,852 % éch. 29/10/2054 | 37 443 | 41 511 | 0,06 |
| MASTR Asset Securitization Trust | | | | 5,930 % éch. 25/06/2047 | \$ 7 965 | 6 567 | 0,01 | 5,302 % éch. 29/10/2054 | 8 681 | 9 567 | 0,01 |
| 5,000 % éch. 25/07/2019 | 0 | 0 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/09/2037 | 3 285 | 2 449 | 0,00 | 5,602 % éch. 29/10/2054 | 6 313 | 6 901 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/06/2036 | 1 678 | 979 | 0,00 | MortgageIT Trust | | | | 6,582 % éch. 29/10/2054 | 4 735 | 5 166 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/10/2036 | 651 | 532 | 0,00 | 6,030 % éch. 25/10/2035 | 121 | 118 | 0,00 | 8,452 % éch. 29/10/2054 | 3 946 | 4 296 | 0,01 |
| MASTR Reperforming Loan Trust | | | | 6,070 % éch. 25/08/2035 | 1 526 | 1 452 | 0,00 | RBSGC Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,830 % éch. 25/07/2035 | 2 936 | 1 544 | 0,00 | 6,090 % éch. 25/12/2035 | 1 464 | 1 431 | 0,00 | 5,920 % éch. 25/01/2037 | \$ 520 | 166 | 0,00 |
| 7,000 % éch. 25/08/2034 | 10 | 7 | 0,00 | 6,355 % éch. 25/02/2035 | 314 | 294 | 0,00 | RBSGC Structured Trust | | | |
| MASTR Seasoned Securitization Trust | | | | 6,707 % éch. 25/02/2035 | 2 | 2 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 62 | 52 | 0,00 |
| 5,870 % éch. 25/10/2032 | 126 | 111 | 0,00 | Mortimer BTL PLC | | | | RBSSP Resecuritization Trust | | | |
| Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust | | | | 0,000 % éch. 22/12/2056 | £ 38 800 | 49 588 | 0,07 | 3,918 % éch. 26/12/2036 | 3 036 | 2 817 | 0,01 |
| 5,916 % éch. 15/12/2030 | 2 | 2 | 0,00 | MSDB Trust | | | | 4,720 % éch. 26/01/2036 | 4 706 | 4 203 | 0,01 |
| 5,956 % éch. 15/06/2030 | 311 | 298 | 0,00 | 3,316 % éch. 11/07/2039 | \$ 1 600 | 1 410 | 0,00 | 5,697 % éch. 27/06/2036 | 2 100 | 1 729 | 0,00 |
| Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust | | | | MSSG Trust | | | | 6,000 % éch. 26/05/2036 | 1 470 | 628 | 0,00 |
| 5,870 % éch. 25/03/2037 | 625 | 160 | 0,00 | 3,397 % éch. 13/09/2039 | 9 550 | 7 612 | 0,01 | 6,000 % éch. 26/08/2037 | 557 | | |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust | | | | 6,500 % éch. 25/04/2037 | \$ 9 889 | \$ 2 680 | 0,00 | 6,721 % éch. 20/07/2060 | £ 9 236 | \$ 11 770 | 0,02 |
| 1,080 % éch. 25/12/2036 (a) | \$ 1 839 | \$ 217 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/06/2037 | 6 886 | 1 575 | 0,00 | 7,721 % éch. 20/07/2060 | 5 907 | 7 526 | 0,01 |
| 1,170 % éch. 25/01/2037 (a) | 1 819 | 194 | 0,00 | 6,609 % éch. 25/02/2037 | 11 448 | 2 725 | 0,01 | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | |
| 1,180 % éch. 25/12/2036 (a) | 738 | 69 | 0,00 | Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust | | | | 4,233 % éch. 25/10/2036 | \$ 1 983 | 1 773 | 0,00 |
| 1,730 % éch. 25/12/2036 (a) | 1 116 | 162 | 0,00 | 2,450 % éch. 25/09/2036 | 68 | 25 | 0,00 | 4,562 % éch. 25/07/2035 | 621 | 529 | 0,00 |
| 4,129 % éch. 25/02/2035 | 440 | 383 | 0,00 | 3,847 % éch. 25/06/2035 | 251 | 153 | 0,00 | 4,635 % éch. 25/07/2035 | 171 | 90 | 0,00 |
| 4,556 % éch. 25/08/2035 | 113 | 99 | 0,00 | 4,003 % éch. 25/08/2035 | 37 | 16 | 0,00 | 4,669 % éch. 25/02/2036 | 2 883 | 2 301 | 0,00 |
| 5,045 % éch. 25/02/2035 | 419 | 209 | 0,00 | 4,500 % éch. 25/10/2018 | 13 | 5 | 0,00 | 4,831 % éch. 25/11/2035 | 46 | 29 | 0,00 |
| 5,065 % éch. 25/07/2035 | 800 | 751 | 0,00 | 4,657 % éch. 25/04/2037 | 86 | 72 | 0,00 | 4,856 % éch. 25/11/2037 | 320 | 262 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/06/2035 | 852 | 702 | 0,00 | 4,657 % éch. 25/04/2037 | 337 | 274 | 0,00 | 4,924 % éch. 25/08/2036 | 3 044 | 2 019 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/09/2035 | 1 327 | 1 088 | 0,00 | 4,742 % éch. 25/04/2037 | 118 | 61 | 0,00 | 4,965 % éch. 25/05/2036 | 831 | 608 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/02/2036 | 544 | 440 | 0,00 | 4,878 % éch. 27/07/2037 | 377 | 283 | 0,00 | 5,193 % éch. 25/01/2035 | 491 | 454 | 0,00 |
| 5,660 % éch. 25/07/2037 | 3 941 | 3 560 | 0,01 | 5,091 % éch. 25/09/2035 | 2 326 | 1 552 | 0,00 | 5,193 % éch. 25/01/2035 | 198 | 179 | 0,00 |
| 5,670 % éch. 25/05/2037 | 96 | 87 | 0,00 | 5,363 % éch. 25/08/2036 | 1 124 | 794 | 0,00 | 5,348 % éch. 25/11/2037 | 179 | 119 | 0,00 |
| 5,720 % éch. 25/03/2036 | 1 984 | 1 417 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/06/2036 | 256 | 213 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/09/2034 | 297 | 259 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/01/2037 | 1 463 | 1 098 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/07/2036 | 185 | 155 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/01/2037 | 1 802 | 1 594 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/08/2035 | 141 | 106 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/09/2036 | 701 | 519 | 0,00 | 5,890 % éch. 25/10/2035 | 1 896 | 1 733 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/12/2036 | 3 427 | 2 275 | 0,00 | 6,250 % éch. 25/08/2036 | 1 175 | 953 | 0,00 | 5,910 % éch. 25/05/2037 | 755 | 656 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/06/2037 | 902 | 836 | 0,00 | Residential Mortgage Securities PLC | | | | 5,926 % éch. 25/09/2034 | 2 | 1 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/02/2047 | 1 378 | 1 197 | 0,00 | 6,470 % éch. 20/06/2070 | £ 9 750 | 12 453 | 0,02 | 5,950 % éch. 25/05/2037 | 1 383 | 1 192 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/01/2037 | 4 576 | 4 012 | 0,01 | 7,120 % éch. 20/06/2070 | 1 355 | 1 729 | 0,00 | 6,020 % éch. 25/09/2034 | 3 943 | 3 395 | 0,01 |
| 5,791 % éch. 25/10/2037 | 4 585 | 3 873 | 0,01 | RESIMAC Bastille Trust | | | | 6,212 % éch. 25/02/2035 | 2 495 | 2 365 | 0,00 |
| 5,810 % éch. 25/12/2036 | 2 299 | 2 272 | 0,00 | 5,590 % éch. 05/09/2057 AUD | 9 566 | 6 529 | 0,01 | 6,227 % éch. 25/04/2036 | 316 | 265 | 0,00 |
| 5,810 % éch. 25/01/2037 | 1 798 | 1 530 | 0,00 | RESIMAC Premier | | | | 6,383 % éch. 25/01/2035 | 43 | 40 | 0,00 |
| 5,814 % éch. 25/05/2046 | 69 | 0 | 0,00 | 5,595 % éch. 07/02/2052 | 2 646 | 1 808 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/08/2035 | 1 620 | 1 417 | 0,00 |
| 5,820 % éch. 25/12/2036 | 1 975 | 1 436 | 0,00 | 6,524 % éch. 07/02/2052 | \$ 897 | 897 | 0,00 | 6,798 % éch. 25/10/2035 | 86 | 76 | 0,00 |
| 5,830 % éch. 25/07/2036 | 6 678 | 3 178 | 0,01 | Resloc UK PLC | | | | 7,068 % éch. 25/12/2034 | 11 | 11 | 0,00 |
| 5,830 % éch. 25/01/2037 | 1 823 | 1 215 | 0,00 | 5,559 % éch. 15/12/2043 | £ 2 235 | 2 648 | 0,00 | Structured Asset Mortgage Investments Trust | | | |
| 5,850 % éch. 25/07/2036 | 1 187 | 1 109 | 0,00 | 5,578 % éch. 15/12/2043 | \$ 12 331 | 11 967 | 0,02 | 3,743 % éch. 25/05/2047 | 2 964 | 2 367 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/09/2036 | 1 620 | 1 557 | 0,00 | Ripon Mortgages PLC | | | | 3,887 % éch. 19/10/2034 | 2 87 | 238 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/12/2036 | 1 369 | 1 180 | 0,00 | 5,920 % éch. 28/08/2056 | £ 417 156 | 530 215 | 0,75 | 4,736 % éch. 27/12/2035 | 24 | 24 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/05/2047 | 910 | 797 | 0,00 | River Green Finance DAC | | | | 5,590 % éch. 25/08/2036 | 9 130 | 7 810 | 0,01 |
| 5,870 % éch. 25/08/2036 | 136 | 101 | 0,00 | 4,702 % éch. 22/01/2032 | € 13 186 | 13 860 | 0,02 | 5,590 % éch. 25/10/2036 | 3 839 | 3 313 | 0,01 |
| 5,870 % éch. 25/05/2037 | 2 893 | 2 065 | 0,00 | RiverView HECM Trust | | | | 5,640 % éch. 25/02/2036 | 1 960 | 1 605 | 0,00 |
| 5,900 % éch. 25/05/2046 | 2 518 | 2 155 | 0,00 | 5,740 % éch. 25/05/2047 | \$ 3 122 | 2 897 | 0,01 | 5,650 % éch. 25/01/2037 | 1 975 | 1 665 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/09/2035 | 1 977 | 1 649 | 0,00 | RMAC PLC | | | | 5,790 % éch. 25/01/2037 | 3 074 | 2 705 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/12/2035 | 1 653 | 1 437 | 0,00 | 0,000 % éch. 15/02/2047 | £ 27 973 | 35 784 | 0,05 | 5,830 % éch. 25/07/2046 | 3 773 | 3 114 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/04/2036 | 971 | 766 | 0,00 | RMAC Securities PLC | | | | 5,830 % éch. 25/09/2047 | 185 | 166 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/05/2036 | 432 | 341 | 0,00 | 4,100 % éch. 12/06/2044 | € 1 713 | 1 833 | 0,00 | 5,870 % éch. 25/02/2036 | 306 | 243 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/06/2036 | 2 505 | 1 928 | 0,00 | 4,190 % éch. 12/06/2044 | 5 527 | 5 759 | 0,01 | 5,890 % éch. 25/05/2036 | 2 498 | 1 682 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/07/2036 | 260 | 202 | 0,00 | 4,220 % éch. 12/06/2044 | 1 605 | 1 677 | 0,00 | 5,890 % éch. 25/09/2047 | 12 423 | 10 308 | 0,02 |
| 6,000 % éch. 25/08/2036 | 4 784 | 3 906 | 0,01 | 4,420 % éch. 12/06/2044 | 5 411 | 5 572 | 0,01 | 5,910 % éch. 25/05/2036 | 9 866 | 7 761 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/09/2036 | 855 | 645 | 0,00 | 5,489 % éch. 12/06/2044 | £ 2 710 | 3 337 | 0,01 | 5,910 % éch. 25/09/2047 | 9 091 | 7 831 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/11/2036 | 175 | 130 | 0,00 | 5,509 % éch. 12/06/2044 | 20 094 | 24 686 | 0,04 | 5,930 % éch. 25/02/2036 | 1 074 | 911 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/01/2037 | 3 753 | 2 905 | 0,01 | 5,769 % éch. 12/06/2044 | 693 | 834 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/05/2045 | 54 | 48 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/03/2037 | 4 794 | 3 625 | 0,01 | 5,827 % éch. 12/06/2044 | \$ 270 | 261 | 0,00 | 5,950 % éch. 19/04/2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/04/2037 | 333 | 259 | 0,00 | 6,169 % éch. 12/06/2044 | £ 1 325 | 1 593 | 0,00 | 5,970 % éch. 19/07/2035 | 32 | 29 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/05/2037 | 296 | 228 | 0,00 | Rochester Financing PLC | | | | 6,020 % éch. 25/09/2047 | 5 030 | 4 070 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/06/2037 | 425 | 320 | 0,00 | 5,920 % éch. 18/12/2044 | 2 048 | 2 591 | 0,00 | 6,030 % éch. 25/02/2036 | 75 | 62 | 0,00 |
| 6,010 % éch. 25/02/2046 | 68 | 40 | 0,00 | Roundstone Securities DAC | | | | 6,070 % éch. 19/07/2034 | 409 | 359 | 0,00 |
| 6,010 % éch. 25/05/2046 | 2 309 | 1 804 | 0,00 | 0,000 % éch. 28/09/2055 | € 19 776 | 20 612 | 0,03 | 6,070 % éch. 25/08/2036 | 6 369 | 4 491 | 0,01 |
| 6,012 % éch. 25/01/2046 | 157 | 124 | 0,00 | 1,000 % éch. 28/09/2055 | 3 941 | 4 147 | 0,01 | 6,170 % éch. 19/12/2034 | 91 | 81 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 25/04/2036 | 1 929 | 1 661 | 0,00 | 4,516 % éch. 28/09/2055 | 97 600 | 107 774 | 0,15 | 6,412 % éch. 25/12/2035 | 1 228 | 982 | 0,00 |
| 6,250 % éch. 25/01/2037 | 107 | 87 | 0,00 | 4,666 % éch. 28/09/2055 | 15 538 | 17 135 | 0,03 | 6,472 % éch. 25/03/2046 | 737 | 656 | 0,00 |
| 6,250 % éch. 25/02/2037 | 2 634 | 2 040 | 0,00 | 4,916 % éch. 28/09/2055 | 10 594 | 11 677 | 0,02 | 6,512 % éch. 25/08/2047 | 9 043 | 7 300 | 0,01 |
| 6,288 % éch. 25/11/2037 | 420 | 343 | 0,00 | 5,416 % éch. 28/09/2055 | 6 356 | 6 985 | 0,01 | 6,595 % éch. 19/12/2033 | 322 | 303 | 0,00 |
| 6,342 % éch. 25/02/2036 | 1 833 | 1 566 | 0,00 | 6,166 % éch. 28/09/2055 | 10 594 | 11 622 | 0,02 | Structured Asset Securities Corp. | | | |
| 6,372 % éch. 25/09/2045 | 341 | 298 | 0,00 | Sequoia Mortgage Trust | | | | 5,720 % éch. 25/07/2035 | 1 660 | 1 514 | 0,00 |
| 6,500 % éch. 25/09/2036 | 470 | 217 | 0,00 | 3,917 % éch. 20/07/2037 | \$ 1 425 | 1 050 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/01/2036 | 68 | 56 | 0,00 |
| 6,500 % éch. 25/11/2036 | 226 | 181 | 0,00 | 4,021 % éch. 20/06/2037 | 3 258 | 2 674 | 0,00 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,500 % éch. 25/02/2037 | 4 498 | 3 543 | 0,01 | 6,112 % éch. 20/11/2034 | 617 | 565 | 0,00 | 5,720 % éch. 25/05/2036 | 1 900 | 1 541 | 0,00 |
| 6,512 % éch. 25/08/2035 | 1 546 | 1 266 | 0,00 | 6,429 % éch. 20/02/2034 | 195 | 173 | 0,00 | SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,750 % éch. 25/06/2037 | 893 | 372 | 0,00 | Sestante Finance SRL | | | | 4,169 % éch. 25/06/2037 | 995 | 908 | 0,00 |
| Residential Asset Securitization Trust | | | | 4,222 % éch. 23/07/2046 | € 14 480 | 14 716 | 0,02 | 4,456 % éch. 25/10/2037 | 517 | 445 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/08/2034 | 774 | 750 | 0,00 | Shamrock Residential DAC | | | | TBW Mortgage-Backed Trust | | | |
| 5,500 % éch. 25/09/2035 | 2 568 | 1 246 | 0,00 | 4,726 % éch. 24/01/2061 | 44 094 | 48 543 | 0,07 | 5,500 % éch. 25/07/2036 | 10 | 1 | 0,00 |
| 5,500 % éch. 25/11/2035 | 107 | 53 | 0,00 | 4,876 % éch. 24/06/2071 | 28 767 | 31 626 | 0,05 | 5,965 % éch. 25/07/2037 | 3 607 | 1 110 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/02/2036 | 1 238 | 1 156 | 0,00 | 5,126 % éch. 24/02/2071 | 40 477 | 44 648 | 0,06 | 6,450 % éch. 25/03/2037 | 13 097 | 2 875 | 0,01 |
| 5,780 % éch. 25/04/2037 | 4 141 | 955 | 0,00 | Stratton BTL Mortgage Funding PLC | | | | TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos | | | |
| 6,000 % éch. 25/07/2035 | 1 311 | 865 | 0,00 | 5,951 % éch. 20/01/2054 | £ 20 580 | 26 158 | 0,04 | 4,096 % éch. 22/06/2040 | € 5 534 | 5 657 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/02/2036 | 17 178 | 7 109 | 0,01 | Stratton Hawksmoor PLC | | | | Temple Quay PLC | | | |
| 6,000 % éch. 25/04/2036 | 2 892 | 1 345 | 0,00 | 6,720 % éch. 25/02/2053 | 63 113 | 79 782 | 0,11 | 7,220 % éch. 24/07/2085 | £ 15 905 | 20 100 | 0,03 |
| 6,000 % éch. 25/06/2036 | 3 962 | 1 682 | 0,00 | 6,970 % éch. 25/02/2053 | 37 882 | 47 505 | 0,07 | 8,220 % éch. 24/07/2085 | 14 681 | 18 555 | 0,03 |
| 6,000 % éch. 25/09/2036 | 7 174 | 2 378 | 0,00 | 7,220 % éch. 25/02/2053 | 2 | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,309 % éch. 25/07/2036 | \$ 1 278 | \$ 1 042 | 0,00 | 4,544 % éch. 25/08/2036 | \$ 632 | \$ 541 | 0,00 | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust | | | |
| 6,815 % éch. 25/06/2037 | 102 | 88 | 0,00 | 4,544 % éch. 25/08/2036 | 169 | 142 | 0,00 | 4,346 % éch. 25/04/2037 | \$ 459 | \$ 383 | 0,00 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC | | | | 4,549 % éch. 25/07/2037 | 3 642 | 3 042 | 0,01 | 4,604 % éch. 25/03/2036 | 1 139 | 1 048 | 0,00 |
| 5,891 % éch. 20/10/2051 | £ 16 600 | 21 090 | 0,03 | 4,853 % éch. 25/05/2046 | 42 | 35 | 0,00 | 4,773 % éch. 25/04/2036 | 1 633 | 1 535 | 0,00 |
| 6,271 % éch. 20/10/2051 | 13 000 | 16 419 | 0,02 | 4,923 % éch. 25/12/2035 | 5 237 | 4 754 | 0,01 | 4,792 % éch. 25/04/2036 | 1 231 | 1 166 | 0,00 |
| 6,365 % éch. 20/10/2051 | 4 475 | 5 710 | 0,01 | 4,951 % éch. 25/07/2034 | 170 | 105 | 0,00 | 5,742 % éch. 25/08/2036 | 938 | 884 | 0,00 |
| 6,421 % éch. 20/10/2051 | 6 118 | 7 749 | 0,01 | 5,240 % éch. 25/01/2035 | 1 684 | 1 527 | 0,00 | 5,872 % éch. 25/10/2036 | 93 | 80 | 0,00 |
| 6,570 % éch. 20/05/2045 | 46 879 | 59 851 | 0,09 | 5,712 % éch. 25/02/2047 | 2 359 | 1 972 | 0,00 | 5,924 % éch. 25/11/2037 | 249 | 216 | 0,00 |
| 6,571 % éch. 20/07/2045 | 34 703 | 44 361 | 0,06 | 5,712 % éch. 25/03/2047 | 488 | 404 | 0,00 | 5,948 % éch. 25/10/2036 | 1 880 | 1 729 | 0,00 |
| 6,621 % éch. 20/10/2051 | 4 000 | 5 062 | 0,01 | 5,762 % éch. 25/06/2047 | 11 284 | 9 081 | 0,01 | 5,951 % éch. 25/08/2035 | 720 | 694 | 0,00 |
| 6,690 % éch. 20/02/2045 | 12 599 | 16 205 | 0,02 | 5,772 % éch. 25/04/2047 | 200 | 171 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/06/2037 | 739 | 670 | 0,00 |
| 7,271 % éch. 20/10/2051 | 13 500 | 17 043 | 0,03 | 5,782 % éch. 25/04/2047 | 1 632 | 1 326 | 0,00 | 6,029 % éch. 25/10/2037 | 79 | 66 | 0,00 |
| 7,721 % éch. 20/10/2051 | 4 500 | 5 670 | 0,01 | 5,782 % éch. 25/05/2047 | 4 349 | 3 480 | 0,01 | 6,132 % éch. 25/09/2036 | 1 040 | 977 | 0,00 |
| Towd Point Mortgage Trust | | | | 5,810 % éch. 25/07/2047 | 1 497 | 1 243 | 0,00 | 6,355 % éch. 25/12/2036 | 708 | 686 | 0,00 |
| 2,750 % éch. 25/06/2057 | \$ 5 305 | 5 104 | 0,01 | 5,822 % éch. 25/02/2046 | 11 826 | 9 407 | 0,01 | Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust | | | |
| 2,750 % éch. 25/10/2057 | 8 909 | 8 561 | 0,01 | 5,892 % éch. 25/10/2046 | 5 981 | 4 987 | 0,01 | 0,469 % éch. 15/03/2047 (a) | 83 200 | 66 | 0,00 |
| 3,000 % éch. 25/06/2058 | 1 792 | 1 676 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/04/2045 | 7 540 | 7 316 | 0,01 | 0,617 % éch. 15/03/2047 (a) | 65 193 | 3 | 0,00 |
| 3,250 % éch. 25/07/2056 | 5 700 | 5 538 | 0,01 | 5,932 % éch. 25/09/2046 | 2 958 | 2 582 | 0,00 | Worldwide Plaza Trust | | | |
| 3,750 % éch. 25/04/2055 | 6 605 | 6 351 | 0,01 | 6,002 % éch. 25/06/2046 | 1 640 | 1 418 | 0,00 | 3,596 % éch. 10/11/2036 | 62 600 | 14 049 | 0,02 |
| 3,750 % éch. 25/10/2056 | 23 315 | 22 433 | 0,03 | 6,010 % éch. 25/07/2045 | 508 | 476 | 0,00 | | | | |
| Tower Bridge Funding PLC | | | | 6,012 % éch. 25/02/2046 | 2 374 | 2 084 | 0,00 | | | | |
| 0,000 % éch. 20/01/2066 (c) | £ 25 550 | 32 627 | 0,05 | 6,060 % éch. 25/08/2046 | 2 161 | 1 749 | 0,00 | | | | |
| 5,940 % éch. 20/12/2063 | 2 219 | 2 814 | 0,01 | 6,090 % éch. 25/01/2045 | 783 | 758 | 0,00 | | | | |
| 6,000 % éch. 20/11/2063 | 12 317 | 15 667 | 0,02 | 6,170 % éch. 25/12/2045 | 1 448 | 1 298 | 0,00 | | | | |
| 6,320 % éch. 20/11/2063 | 1 500 | 1 900 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/10/2045 | 105 | 98 | 0,00 | | | | |
| Trinity Square PLC | | | | 6,210 % éch. 25/01/2045 | 1 906 | 1 849 | 0,00 | | | | |
| 6,620 % éch. 15/07/2059 | 34 300 | 43 641 | 0,06 | 6,262 % éch. 25/01/2047 | 4 826 | 4 271 | 0,01 | Accredited Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,920 % éch. 15/07/2059 | 12 400 | 15 758 | 0,02 | 6,270 % éch. 25/06/2044 | 113 | 103 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/02/2037 | 1 000 | 950 | 0,00 |
| 7,220 % éch. 15/07/2059 | 9 600 | 12 156 | 0,02 | 6,370 % éch. 25/10/2045 | 7 227 | 6 033 | 0,01 | 5,730 % éch. 25/09/2036 | 4 147 | 4 092 | 0,01 |
| 7,970 % éch. 15/07/2059 | 5 700 | 7 215 | 0,01 | 6,450 % éch. 25/10/2045 | 327 | 304 | 0,00 | 5,740 % éch. 25/09/2036 | 12 825 | 11 980 | 0,02 |
| Tudor Rose Mortgages | | | | 6,470 % éch. 25/12/2045 | 5 473 | 5 348 | 0,01 | 5,740 % éch. 25/02/2037 | 8 675 | 7 366 | 0,01 |
| 5,820 % éch. 20/06/2048 | 5 310 | 6 734 | 0,01 | 6,490 % éch. 25/08/2045 | 3 941 | 3 707 | 0,01 | 5,930 % éch. 25/12/2035 | 12 334 | 9 086 | 0,01 |
| Twin Bridges PLC | | | | 6,512 % éch. 25/09/2046 | 2 225 | 2 056 | 0,00 | 6,340 % éch. 25/09/2035 | 5 921 | 5 533 | 0,01 |
| 6,170 % éch. 14/06/2055 | 32 721 | 41 666 | 0,06 | 6,512 % éch. 25/10/2046 | 2 013 | 1 803 | 0,00 | 6,490 % éch. 25/07/2035 | 2 496 | 2 298 | 0,01 |
| 6,432 % éch. 15/05/2056 | 38 456 | 49 129 | 0,07 | 6,512 % éch. 25/11/2046 | 1 765 | 1 557 | 0,00 | 6,550 % éch. 25/10/2034 | 1 591 | 1 518 | 0,00 |
| 6,470 % éch. 12/12/2054 | 22 507 | 28 737 | 0,04 | Warwick Finance Residential Mortgages PLC | | | | Accunia European CLO DAC | | | |
| 7,220 % éch. 12/06/2055 | 5 819 | 7 448 | 0,01 | 0,000 % éch. 21/12/2049 (f) | £ 2 | 10 270 | 0,02 | 4,973 % éch. 20/04/2033 | € 6 100 | 6 635 | 0,01 |
| UBS Commercial Mortgage Trust | | | | 6,170 % éch. 21/12/2049 | 51 222 | 65 467 | 0,09 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | |
| 6,259 % éch. 15/02/2032 | \$ 1 737 | 1 726 | 0,00 | 6,239 % éch. 21/03/2042 | 2 310 | 2 950 | 0,01 | 5,590 % éch. 25/12/2036 | \$ 10 504 | 5 433 | 0,01 |
| Uropa Securities PLC | | | | 6,870 % éch. 21/12/2049 | 12 810 | 16 195 | 0,02 | 5,640 % éch. 25/11/2036 | 18 399 | 7 595 | 0,01 |
| 4,183 % éch. 10/10/2040 | € 5 295 | 5 641 | 0,01 | 7,370 % éch. 21/12/2049 | 6 405 | 8 051 | 0,01 | 5,650 % éch. 25/01/2037 | 1 839 | 1 101 | 0,00 |
| 5,690 % éch. 10/10/2040 | € 6 899 | 8 004 | 0,01 | 7,870 % éch. 21/12/2049 | 3 660 | 4 585 | 0,01 | 5,650 % éch. 25/02/2037 | 5 925 | 2 506 | 0,00 |
| Verus Securitization Trust | | | | 8,370 % éch. 21/12/2049 | 3 660 | 4 507 | 0,01 | 5,710 % éch. 25/08/2036 | 8 519 | 2 076 | 0,00 |
| 1,977 % éch. 25/03/2060 | \$ 184 | 182 | 0,00 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | 5,710 % éch. 25/01/2037 | 1 134 | 679 | 0,00 |
| 3,035 % éch. 25/03/2060 | 700 | 682 | 0,00 | 4,052 % éch. 25/09/2036 | \$ 598 | 191 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/12/2036 | 24 901 | 13 580 | 0,02 |
| 3,889 % éch. 25/03/2060 | 1 000 | 970 | 0,00 | 4,157 % éch. 25/10/2036 | 9 500 | 3 390 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/07/2036 | 4 913 | 4 465 | 0,01 |
| Wachovia Mortgage Loan Trust | | | | 4,282 % éch. 25/10/2036 | 3 920 | 1 124 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 32 514 | 10 736 | 0,02 |
| 1,823 % éch. 25/08/2036 | 1 289 | 452 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/05/2035 | 2 960 | 2 385 | 0,00 | 5,780 % éch. 25/08/2036 | 4 734 | 4 504 | 0,01 |
| 1,850 % éch. 25/01/2037 | 2 054 | 754 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/06/2035 | 307 | 237 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/12/2036 | 1 641 | 568 | 0,00 |
| Wachovia Mortgage Loan Trust LLC | | | | 5,500 % éch. 25/07/2035 | 954 | 860 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/01/2037 | 3 715 | 2 224 | 0,00 |
| 5,373 % éch. 20/08/2035 | 131 | 125 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 82 | 71 | 0,00 | 5,840 % éch. 25/02/2037 | 5 810 | 2 457 | 0,00 |
| 6,161 % éch. 20/10/2035 | 200 | 189 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/01/2036 | 2 017 | 1 710 | 0,00 | 5,910 % éch. 25/12/2036 | 193 | 67 | 0,00 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | 5,750 % éch. 25/02/2036 | 125 | 111 | 0,00 | 5,910 % éch. 25/01/2037 | 10 498 | 2 510 | 0,00 |
| 3,224 % éch. 25/01/2037 | 756 | 621 | 0,00 | 5,772 % éch. 25/04/2047 | 4 121 | 3 381 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/04/2036 | 6 034 | 5 444 | 0,01 |
| 3,374 % éch. 25/01/2037 | 2 656 | 2 326 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/02/2037 | 684 | 521 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/07/2036 | 7 133 | 2 167 | 0,00 |
| 3,461 % éch. 25/03/2037 | 956 | 763 | 0,00 | 5,820 % éch. 25/02/2036 | 1 268 | 1 095 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/01/2037 | 1 134 | 679 | 0,00 |
| 3,657 % éch. 25/02/2037 | 1 420 | 1 225 | 0,00 | 5,842 % éch. 25/11/2046 | 98 | 80 | 0,00 | 6,030 % éch. 25/06/2037 | 1 488 | 1 352 | 0,00 |
| 3,698 % éch. 25/02/2037 | 3 675 | 3 294 | 0,01 | 5,850 % éch. 25/06/2037 | 391 | 362 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/02/2036 | 546 | 537 | 0,00 |
| 3,787 % éch. 25/02/2037 | 7 976 | 7 252 | 0,01 | 5,932 % éch. 25/09/2046 | 3 657 | 2 638 | 0,00 | 6,085 % éch. 25/12/2035 | 3 889 | 3 590 | 0,01 |
| 3,814 % éch. 25/06/2037 | 1 436 | 1 230 | 0,00 | 5,952 % éch. 25/07/2046 | 5 984 | 3 652 | 0,01 | 6,130 % éch. 25/11/2035 | 1 506 | 1 530 | 0,00 |
| 3,834 % éch. 25/06/2037 | 1 265 | 1 079 | 0,00 | 5,972 % éch. 25/08/2046 | 3 626 | 1 997 | 0,00 | 6,250 % éch. 25/04/2034 | 869 | 802 | 0,00 |
| 3,858 % éch. 25/02/2037 | 1 658 | 1 447 | 0,00 | 5,990 % éch. 25/12/2035 | 2 570 | 2 139 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/12/2034 | 3 235 | 2 930 | 0,01 |
| 3,880 % éch. 25/05/2037 | 1 060 | 879 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/11/2035 | 2 141 | 2 049 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/08/2035 | 3 118 | 3 023 | 0,01 |
| 3,901 % éch. 25/05/2037 | 1 356 | 1 141 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/07/2036 | 4 200 | 3 239 | 0,01 | 6,415 % éch. 25/05/2035 | 3 000 | 2 701 | 0,00 |
| 3,910 % éch. 25/09/2036 | 109 | 91 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/04/2037 | 2 095 | 1 776 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/11/2033 | 661 | 644 | 0,00 |
| 3,927 % éch. 25/04/2035 | 1 318 | 1 264 | 0,00 | 6,262 % éch. 25/04/2047 | 16 942 | 14 105 | 0,02 | 6,490 % éch. 25/04/2035 | 1 447 | 1 408 | 0,00 |
| 4,007 % éch. 25/06/2037 | 917 | 797 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/11/2035 | 3 293 | 2 191 | 0,00 | Adagio CLO DAC | | | |
| 4,020 % éch. 25/11/2036 | 4 305 | 3 689 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/03/2036 | 3 148 | 2 241 | 0,00 | 4,895 % éch. 15/04/2032 | € 14 700 | 16 089 | 0,02 |
| 4,063 % éch. 25/12/2036 | 673 | 574 | 0,00 | 6,812 % éch. 25/07/2036 | 10 686 | 2 663 | 0,00 | Aegis Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 4,077 % éch. 25/03/2035 | 1 848 | 1 772 | 0,00 | 6,949 % éch. 25/07/2036 | 1 943 | 484 | 0,00 | 5,640 % éch. 25/01/2037 | \$ 1 170 | 856 | 0,00 |
| 4,106 % éch. 25/07/2037 | 4 446 | 3 849 | 0,01 | 7,000 % éch. 25/02/2036 | 2 578 | 1 824 | 0,00 | 6,115 % éch. 25/12/2035 | 3 535 | 3 217 | 0,01 |
| 4,172 % éch. 25/09/2036 | 3 871 | 3 313 | 0,01 | 7,000 % éch. 25/05/2036 | 2 894 | 2 440 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/06/2035 | 5 675 | 5 299 | 0,01 |
| 4,272 % éch. 25/12/2036 | 6 084 | 5 306 | 0,01 | Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | 6,190 % éch. 25/08/2035 | 676 | 655 | 0,00 |
| 4,311 % éch. 25/03/2037 | 111 | 101 | 0,00 | 4,386 % éch. 25/01/2035 | 1 | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) \$ | JUSTE VALEUR (en milliers) \$ | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) \$ | JUSTE VALEUR (en milliers) \$ | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) € | JUSTE VALEUR (en milliers) € | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|---|--|------------------------------|--|---|--|------------------------------|---|--|---------------------------------------|------------------------------|
| 5,993 % éch. 23/12/2035 | 7 979 | 7 660 | 0,01 | 6,170 % éch. 25/06/2034 | 2 840 | 2 782 | 0,00 | Blackrock European CLO DAC | | | |
| 6,013 % éch. 23/09/2037 | 2 000 | 1 540 | 0,00 | 6,250 % éch. 25/11/2033 | 892 | 850 | 0,00 | 4,815 % éch. 15/07/2030 | 8 373 | 9 193 | 0,01 |
| 6,063 % éch. 23/12/2036 | 5 000 | 3 950 | 0,01 | 6,370 % éch. 25/02/2034 | 176 | 174 | 0,00 | BNC Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,363 % éch. 23/09/2038 | 6 698 | 6 095 | 0,01 | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | 4,291 % éch. 25/10/2036 | 5 508 | 3 892 | 0,01 |
| Allegro CLO Ltd. | | | | 3,008 % éch. 25/07/2036 | 480 | 378 | 0,00 | 5,630 % éch. 25/03/2037 | 9 646 | 9 090 | 0,01 |
| 6,755 % éch. 13/06/2031 | 30 395 | 30 390 | 0,04 | 3,367 % éch. 25/03/2036 | 13 | 13 | 0,00 | 5,720 % éch. 25/07/2037 | 9 737 | 8 394 | 0,01 |
| Ameriqest Mortgage Securities Trust | | | | 3,367 % éch. 25/03/2036 | 2 345 | 1 937 | 0,00 | 5,780 % éch. 25/05/2037 | 5 647 | 5 128 | 0,01 |
| 5,570 % éch. 25/10/2036 | 21 274 | 6 267 | 0,01 | 3,646 % éch. 25/03/2036 | 1 062 | 911 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/11/2036 | 972 | 933 | 0,00 |
| 5,645 % éch. 25/10/2036 | 11 832 | 6 602 | 0,01 | 3,920 % éch. 25/12/2036 | 2 017 | 1 903 | 0,00 | BNPP AM Euro CLO DAC | | | |
| 5,980 % éch. 25/04/2036 | 212 | 211 | 0,00 | 4,120 % éch. 25/12/2036 | 3 665 | 3 297 | 0,01 | 4,615 % éch. 15/10/2031 | 11 671 | 12 729 | 0,02 |
| 6,025 % éch. 25/04/2036 | 6 319 | 6 062 | 0,01 | 5,815 % éch. 25/11/2036 | 5 552 | 5 163 | 0,01 | Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust | | | |
| Ameriqest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 6,280 % éch. 25/06/2034 | 776 | 760 | 0,00 | 7,180 % éch. 15/12/2029 | 980 | 110 | 0,00 |
| 3,110 % éch. 25/06/2033 | 1 225 | 1 105 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/11/2035 | 3 597 | 3 381 | 0,01 | 7,440 % éch. 15/12/2029 | 10 140 | 1 181 | 0,00 |
| 4,532 % éch. 25/11/2034 | 3 695 | 3 577 | 0,01 | 6,445 % éch. 25/11/2033 | 903 | 918 | 0,00 | 7,575 % éch. 15/06/2030 | 936 | 109 | 0,00 |
| 4,635 % éch. 25/06/2034 | 1 648 | 1 538 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/10/2034 | 1 108 | 1 068 | 0,00 | Bosporus CLO DAC | | | |
| 4,742 % éch. 25/07/2034 | 178 | 173 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/06/2035 | 2 111 | 1 818 | 0,00 | 4,745 % éch. 15/12/2030 | 9 321 | 10 207 | 0,02 |
| 5,184 % éch. 25/12/2033 | 277 | 264 | 0,00 | 6,490 % éch. 25/07/2035 | 3 159 | 3 011 | 0,01 | Cairn CLO DAC | | | |
| 6,050 % éch. 25/11/2035 | 5 438 | 4 953 | 0,01 | 7,315 % éch. 25/05/2035 | 2 887 | 2 635 | 0,00 | 4,618 % éch. 31/01/2030 | 25 338 | 27 746 | 0,04 |
| 6,145 % éch. 25/01/2036 | 7 973 | 7 797 | 0,01 | Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | | Camber PLC | | | |
| 6,175 % éch. 25/01/2036 | 164 | 164 | 0,00 | 6,805 % éch. 16/01/2030 | 14 073 | 14 054 | 0,02 | 5,832 % éch. 09/11/2053 | 30 714 | 3 | 0,00 |
| 6,220 % éch. 25/01/2036 | 5 050 | 4 886 | 0,01 | 6,840 % éch. 24/10/2031 | 7 456 | 7 451 | 0,01 | Carbone CLO Ltd. | | | |
| 6,400 % éch. 25/05/2035 | 1 410 | 1 390 | 0,00 | Atrium CDO Corp. | | | | 6,817 % éch. 20/01/2031 | 3 833 | 3 836 | 0,01 |
| 6,430 % éch. 25/10/2035 | 5 095 | 4 667 | 0,01 | 6,854 % éch. 21/11/2030 | 16 570 | 16 561 | 0,02 | Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. | | | |
| 6,445 % éch. 25/05/2035 | 2 000 | 1 888 | 0,00 | Aurium CLO DAC | | | | 6,634 % éch. 17/04/2031 | 13 234 | 13 226 | 0,02 |
| 6,445 % éch. 25/07/2035 | 10 140 | 9 443 | 0,01 | 4,635 % éch. 16/04/2030 | 29 716 | 32 466 | 0,05 | 6,691 % éch. 15/05/2031 | 49 906 | 49 857 | 0,07 |
| 6,445 % éch. 25/09/2035 | 5 750 | 4 594 | 0,01 | 4,846 % éch. 22/06/2034 | 5 000 | 5 413 | 0,01 | 6,699 % éch. 27/07/2031 | 17 416 | 17 404 | 0,03 |
| 6,490 % éch. 25/09/2034 | 221 | 217 | 0,00 | 4,966 % éch. 23/03/2032 | 15 500 | 16 990 | 0,02 | 6,795 % éch. 15/07/2031 | 22 399 | 22 373 | 0,03 |
| 6,490 % éch. 25/01/2035 | 1 663 | 1 481 | 0,00 | Auto ABS Spanish Loans | | | | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC | | | |
| 6,520 % éch. 25/05/2035 | 1 961 | 1 707 | 0,00 | 5,665 % éch. 28/02/2032 | 4 881 | 5 349 | 0,01 | 4,925 % éch. 16/01/2033 | 24 500 | 26 649 | 0,04 |
| 6,565 % éch. 25/09/2034 | 3 520 | 3 243 | 0,01 | 6,365 % éch. 28/02/2032 | 7 875 | 8 582 | 0,01 | Carlyle U.S. CLO Ltd. | | | |
| 7,030 % éch. 25/01/2035 | 1 315 | 1 088 | 0,00 | Avoca Static CLO DAC | | | | 6,835 % éch. 15/01/2030 | 8 254 | 8 254 | 0,01 |
| 7,120 % éch. 25/11/2034 | 2 642 | 2 294 | 0,00 | 5,690 % éch. 15/10/2030 | 26 900 | 29 702 | 0,04 | Carrington Mortgage Loan Trust | | | |
| 7,195 % éch. 25/08/2035 | 2 000 | 1 753 | 0,00 | Bain Capital Euro CLO DAC | | | | 5,620 % éch. 25/04/2036 | 1 871 | 1 809 | 0,00 |
| 7,345 % éch. 25/07/2034 | 1 221 | 1 184 | 0,00 | 4,733 % éch. 20/01/2032 | 4 427 | 4 830 | 0,01 | 5,620 % éch. 25/08/2036 | 8 159 | 7 777 | 0,01 |
| 8,230 % éch. 25/05/2034 | 1 323 | 1 164 | 0,00 | 4,773 % éch. 20/04/2032 | 58 473 | 64 132 | 0,09 | 5,630 % éch. 25/10/2036 | 10 036 | 9 741 | 0,01 |
| Anchorage Capital CLO Ltd. | | | | 4,865 % éch. 15/04/2032 | 10 000 | 10 906 | 0,02 | 5,730 % éch. 25/02/2037 | 14 078 | 12 976 | 0,02 |
| 6,855 % éch. 15/10/2031 | 22 500 | 22 532 | 0,03 | Bastille Euro CLO DAC | | | | 6,070 % éch. 25/01/2036 | 965 | 927 | 0,00 |
| Apidos CLO | | | | 5,115 % éch. 15/01/2034 | 20 000 | 21 817 | 0,03 | 6,220 % éch. 25/10/2035 | 6 824 | 6 577 | 0,01 |
| 6,735 % éch. 15/04/2031 | 7 014 | 7 012 | 0,01 | Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust | | | | 6,235 % éch. 25/12/2035 | 2 922 | 2 177 | 0,00 |
| 6,755 % éch. 16/07/2031 | 5 025 | 5 028 | 0,01 | 6,341 % éch. 28/04/2036 | 1 229 | 1 213 | 0,00 | 6,265 % éch. 25/09/2035 | 2 325 | 2 260 | 0,00 |
| 6,847 % éch. 20/10/2031 | 4 750 | 4 755 | 0,01 | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | | 6,460 % éch. 25/06/2035 | 5 260 | 5 159 | 0,01 |
| Arbour CLO DAC | | | | 4,724 % éch. 25/07/2036 | 24 | 23 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/05/2035 | 3 904 | 3 759 | 0,01 |
| 4,905 % éch. 15/03/2033 | 43 600 | 47 520 | 0,07 | 5,031 % éch. 25/11/2035 | 1 772 | 1 723 | 0,00 | CarVal CLO Ltd. | | | |
| Ares CLO Ltd. | | | | 5,401 % éch. 25/06/2035 | 3 349 | 3 275 | 0,01 | 6,815 % éch. 16/07/2031 | 33 800 | 33 841 | 0,05 |
| 6,825 % éch. 15/10/2030 | 23 890 | 23 913 | 0,03 | 5,543 % éch. 25/12/2035 | 2 334 | 2 082 | 0,00 | CBAM Ltd. | | | |
| Ares European CLO DAC | | | | 5,602 % éch. 25/10/2036 | 45 | 45 | 0,00 | 6,684 % éch. 17/04/2031 | 17 569 | 17 542 | 0,03 |
| 4,575 % éch. 15/04/2030 | 1 917 | 2 101 | 0,00 | 5,602 % éch. 25/10/2036 | 43 | 40 | 0,00 | Cedar Funding CLO Ltd. | | | |
| 4,915 % éch. 15/01/2036 | 4 200 | 4 538 | 0,01 | 5,610 % éch. 25/03/2037 | 1 976 | 1 810 | 0,00 | 6,657 % éch. 20/04/2031 | 13 053 | 13 057 | 0,02 |
| 5,122 % éch. 21/10/2033 | 28 450 | 31 108 | 0,04 | 5,612 % éch. 25/09/2034 | 1 336 | 1 313 | 0,00 | 6,677 % éch. 20/01/2031 | 26 394 | 26 369 | 0,04 |
| Argent Securities Trust | | | | 5,612 % éch. 25/09/2034 | 91 | 83 | 0,00 | Centex Home Equity Loan Trust | | | |
| 5,580 % éch. 25/09/2036 | 13 614 | 4 376 | 0,01 | 5,630 % éch. 25/01/2037 | 6 036 | 5 987 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/06/2036 | 1 200 | 1 166 | 0,00 |
| 5,690 % éch. 25/05/2036 | 3 957 | 966 | 0,00 | 5,639 % éch. 25/08/2034 | 415 | 383 | 0,00 | 6,060 % éch. 25/09/2034 | 666 | 657 | 0,00 |
| 5,710 % éch. 25/09/2036 | 10 669 | 3 429 | 0,01 | 5,653 % éch. 25/04/2036 | 1 678 | 1 668 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/01/2035 | 1 003 | 997 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/06/2036 | 15 055 | 9 770 | 0,01 | 5,700 % éch. 25/02/2037 | 1 500 | 1 402 | 0,00 | 6,220 % éch. 25/01/2035 | 1 492 | 1 453 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/07/2036 | 32 417 | 28 252 | 0,04 | 5,720 % éch. 25/04/2037 | 1 414 | 2 116 | 0,00 | 6,385 % éch. 25/10/2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/05/2036 | 11 345 | 2 771 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/11/2036 | 457 | 435 | 0,00 | 6,400 % éch. 25/09/2034 | 194 | 188 | 0,00 |
| 5,820 % éch. 25/04/2036 | 1 542 | 859 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/06/2047 | 161 | 156 | 0,00 | 6,430 % éch. 25/03/2035 | 2 466 | 2 370 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/03/2036 | 14 388 | 10 707 | 0,02 | 5,780 % éch. 25/11/2034 | 345 | 343 | 0,00 | Chase Funding Trust | | | |
| 6,010 % éch. 25/05/2036 | 671 | 164 | 0,00 | 5,788 % éch. 25/01/2035 | 2 044 | 2 058 | 0,00 | 6,220 % éch. 25/09/2033 | 0 | 0 | 0,00 |
| Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 5,810 % éch. 25/05/2035 | 10 | 9 | 0,00 | CIFC Funding Ltd. | | | |
| 5,940 % éch. 25/01/2036 | 6 264 | 6 099 | 0,01 | 5,810 % éch. 25/12/2036 | 8 263 | 7 963 | 0,01 | 6,640 % éch. 24/04/2031 | 7 708 | 7 710 | 0,01 |
| 5,950 % éch. 25/05/2035 | 7 908 | 6 668 | 0,01 | 5,820 % éch. 25/06/2047 | 7 641 | 6 603 | 0,01 | 6,710 % éch. 24/04/2030 | 9 965 | 9 944 | 0,01 |
| 6,130 % éch. 25/11/2035 | 8 104 | 7 821 | 0,01 | 5,830 % éch. 25/10/2036 | 212 | 206 | 0,00 | 6,784 % éch. 22/01/2031 | 13 032 | 13 033 | 0,02 |
| 6,230 % éch. 25/02/2036 | 12 434 | 9 643 | 0,01 | 5,920 % éch. 25/01/2047 | 2 031 | 1 960 | 0,00 | 6,814 % éch. 17/10/2031 | 7 300 | 7 306 | 0,01 |
| 6,235 % éch. 25/10/2035 | 5 750 | 5 114 | 0,01 | 5,970 % éch. 25/08/2036 | 4 592 | 4 154 | 0,01 | 6,844 % éch. 16/11/2030 | 3 201 | 3 203 | 0,01 |
| 6,370 % éch. 25/05/2034 | 1 674 | 1 448 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/05/2037 | 2 137 | 2 048 | 0,00 | 6,897 % éch. 20/07/2030 | 1 641 | 1 643 | 0,00 |
| 6,595 % éch. 25/11/2034 | 2 287 | 2 250 | 0,00 | 5,990 % éch. 25/09/2036 | 1 845 | 1 688 | 0,00 | CIT Mortgage Loan Trust | | | |
| Armada Euro CLO DAC | | | | 6,168 % éch. 25/02/2034 | 249 | 250 | 0,00 | 6,786 % éch. 25/10/2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 4,762 % éch. 15/11/2031 | 12 518 | 13 723 | 0,02 | 6,205 % éch. 25/09/2035 | 144 | 143 | 0,00 | 6,970 % éch. 25/10/2037 | 71 370 | 70 632 | 0,10 |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust | | | | 6,310 % éch. 25/08/2036 | 1 300 | 1 259 | 0,00 | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,600 % éch. 25/01/2037 | 480 | 337 | 0,00 | 6,490 % éch. 25/10/2035 | 1 618 | 1 588 | 0,00 | 4,254 % éch. 25/10/2037 | 1 872 | 1 801 | 0,00 |
| 5,610 % éch. 25/10/2036 | 694 | 642 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/10/2036 | 2 298 | 980 | 0,00 | 5,540 % éch. 25/05/2037 | 1 898 | 1 239 | 0,00 |
| 5,630 % éch. 25/01/2037 | 10 816 | 6 217 | 0,01 | 6,520 % éch. 25/08/2037 | 10 162 | 8 844 | 0,01 | 5,610 % éch. 25/01/2037 | 9 406 | 8 601 | 0,01 |
| 5,690 % éch. 25/10/2036 | 8 670 | 7 351 | 0,01 | 6,595 % éch. 25/02/2035 | 698 | 695 | 0,00 | 5,645 % éch. 25/05/2037 | 314 | 299 | 0,00 |
| 5,690 % éch. 25/01/2037 | 3 565 | 2 054 | 0,00 | 6,670 % éch. 25/06/2036 | 616 | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,760 % éch. 25/09/2036 | \$ 5 677 | \$ 5 430 | 0,01 | 5,650 % éch. 25/06/2047 | 442 | 417 | 0,00 | 3,114 % éch. 25/05/2036 | 3 509 | 2 244 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/12/2036 | 924 | 369 | 0,00 | 5,650 % éch. 25/11/2047 | 1 295 | 1 440 | 0,00 | 3,224 % éch. 25/12/2035 | 190 | 183 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/09/2036 | 1 386 | 1 066 | 0,00 | 5,660 % éch. 25/11/2037 | 7 983 | 7 399 | 0,01 | 3,267 % éch. 25/04/2037 | 3 211 | 2 001 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/12/2036 | 17 399 | 9 719 | 0,01 | 5,670 % éch. 25/06/2047 | 9 565 | 8 557 | 0,01 | 3,454 % éch. 25/04/2037 | 5 575 | 3 353 | 0,01 |
| 5,870 % éch. 25/11/2046 | 4 278 | 4 141 | 0,01 | 5,680 % éch. 25/05/2047 | 6 324 | 5 591 | 0,01 | 3,580 % éch. 25/03/2034 | 312 | 319 | 0,00 |
| 5,890 % éch. 25/12/2036 | 3 539 | 3 453 | 0,01 | 5,690 % éch. 25/06/2037 | 421 | 406 | 0,00 | 4,715 % éch. 25/12/2037 | 584 | 648 | 0,00 |
| 5,890 % éch. 25/01/2037 | 2 154 | 2 106 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/08/2037 | 15 337 | 13 780 | 0,02 | 5,770 % éch. 25/10/2036 | 2 875 | 2 374 | 0,00 |
| 5,920 % éch. 25/01/2037 | 434 | 405 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/09/2037 | 8 563 | 8 729 | 0,01 | 8,845 % éch. 25/01/2033 | 267 | 243 | 0,00 |
| 5,950 % éch. 25/08/2036 | 3 018 | 2 707 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/06/2047 | 21 119 | 19 744 | 0,03 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage | | | |
| 5,970 % éch. 25/08/2036 | 473 | 461 | 0,00 | 5,700 % éch. 25/07/2037 | 15 720 | 13 343 | 0,02 | Loan Trust | | | |
| 5,990 % éch. 25/03/2036 | 3 699 | 3 328 | 0,01 | 5,700 % éch. 25/10/2047 | 4 059 | 3 984 | 0,01 | 3,319 % éch. 25/03/2037 | 107 | 40 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 25/12/2035 | 1 646 | 1 566 | 0,00 | 5,720 % éch. 25/06/2047 | 11 232 | 10 748 | 0,02 | 3,541 % éch. 25/02/2037 | 674 | 417 | 0,00 |
| 6,145 % éch. 25/03/2037 | 6 005 | 5 908 | 0,01 | 5,730 % éch. 25/12/2036 | 6 643 | 6 038 | 0,01 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust | | | |
| 6,352 % éch. 25/05/2036 | 1 000 | 383 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/04/2046 | 807 | 747 | 0,00 | 3,201 % éch. 25/01/2037 | 10 164 | 3 164 | 0,01 |
| 6,851 % éch. 25/05/2036 | 504 | 193 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/06/2047 | 12 311 | 9 763 | 0,01 | 3,400 % éch. 25/07/2036 | 2 009 | 1 849 | 0,00 |
| 7,250 % éch. 25/05/2036 | 11 454 | 5 955 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/02/2037 | 499 | 469 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/11/2036 | 9 593 | 4 257 | 0,01 |
| 7,275 % éch. 25/10/2036 | 973 | 564 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/05/2037 | 5 562 | 5 133 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/11/2036 | 1 704 | 756 | 0,00 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 5,750 % éch. 25/09/2047 | 1 921 | 1 843 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/11/2036 | 5 407 | 2 399 | 0,00 |
| 6,475 % éch. 25/10/2034 | 3 643 | 3 254 | 0,01 | 5,805 % éch. 25/04/2036 | 421 | 372 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/10/2036 | 9 650 | 6 118 | 0,01 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | 5,905 % éch. 25/01/2045 | 2 395 | 2 173 | 0,00 | CSAB Mortgage-Backed Trust | | | |
| 5,730 % éch. 25/03/2037 | 5 392 | 4 658 | 0,01 | 5,910 % éch. 25/05/2037 | 5 772 | 5 410 | 0,01 | 5,858 % éch. 25/05/2037 | 5 319 | 1 288 | 0,00 |
| 5,820 % éch. 25/03/2037 | 1 931 | 1 589 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/05/2037 | 11 900 | 11 020 | 0,02 | 5,898 % éch. 25/05/2037 | 799 | 194 | 0,00 |
| 5,830 % éch. 25/11/2034 | 227 | 225 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/02/2037 | 8 520 | 8 172 | 0,01 | 5,930 % éch. 25/11/2036 | 7 833 | 1 099 | 0,00 |
| 5,905 % éch. 25/11/2036 | 3 919 | 3 848 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/03/2037 | 13 984 | 12 973 | 0,02 | 6,580 % éch. 25/09/2036 | 2 103 | 658 | 0,00 |
| 5,920 % éch. 25/10/2036 | 2 646 | 2 629 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/03/2047 | 6 950 | 5 775 | 0,01 | Cumulus Static CLO DAC | | | |
| 5,935 % éch. 25/08/2036 | 2 105 | 1 946 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/04/2046 | 4 839 | 4 649 | 0,01 | 5,499 % éch. 25/04/2033 | € 23 200 | 25 613 | 0,04 |
| 5,950 % éch. 25/11/2036 | 400 | 372 | 0,00 | 5,971 % éch. 25/09/2046 | 389 | 391 | 0,00 | CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | |
| 5,965 % éch. 25/10/2036 | 400 | 386 | 0,00 | 5,989 % éch. 25/10/2046 | 43 | 42 | 0,00 | 4,652 % éch. 21/07/2030 | 35 517 | 38 791 | 0,06 |
| 6,100 % éch. 25/02/2035 | 1 872 | 1 712 | 0,00 | 5,990 % éch. 25/09/2046 | 18 772 | 17 706 | 0,03 | 5,042 % éch. 20/08/2034 | 5 000 | 5 448 | 0,01 |
| 6,145 % éch. 25/10/2035 | 1 869 | 1 814 | 0,00 | 5,995 % éch. 25/08/2036 | 3 796 | 3 669 | 0,01 | 5,169 % éch. 23/10/2034 | 10 598 | 11 599 | 0,02 |
| 6,205 % éch. 25/09/2035 | 2 052 | 2 026 | 0,00 | 6,025 % éch. 25/07/2036 | 2 908 | 2 682 | 0,00 | Dryden CLO Ltd. | | | |
| 6,250 % éch. 25/01/2036 | 584 | 581 | 0,00 | 6,055 % éch. 25/04/2036 | 1 000 | 912 | 0,00 | 6,627 % éch. 18/04/2031 | \$ 19 014 | 18 981 | 0,03 |
| 7,150 % éch. 25/07/2035 | 3 840 | 3 144 | 0,01 | 6,055 % éch. 25/06/2036 | 4 060 | 3 905 | 0,01 | 6,675 % éch. 15/04/2031 | 3 581 | 3 581 | 0,01 |
| Clarinda Park CLO DAC | | | | 6,070 % éch. 25/06/2036 | 736 | 730 | 0,00 | 6,705 % éch. 15/07/2031 | 2 268 | 2 268 | 0,00 |
| 4,902 % éch. 15/02/2034 | € 1 750 | 1 899 | 0,00 | 6,160 % éch. 25/04/2036 | 14 848 | 14 242 | 0,02 | 6,775 % éch. 15/01/2031 | 30 800 | 30 839 | 0,04 |
| Commonbond Student Loan Trust | | | | 6,170 % éch. 25/03/2036 | 5 446 | 4 751 | 0,01 | Dryden Euro CLO BV | | | |
| 2,550 % éch. 25/05/2041 | \$ 1 782 | 1 672 | 0,00 | 6,175 % éch. 25/09/2035 | 1 393 | 1 326 | 0,00 | 4,715 % éch. 15/07/2032 | € 929 | 1 016 | 0,00 |
| 6,320 % éch. 25/05/2041 | 107 | 105 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/08/2035 | 1 794 | 1 551 | 0,00 | Dryden Euro CLO DAC | | | |
| Consoco Finance Corp. | | | | 6,310 % éch. 25/10/2047 | 1 040 | 995 | 0,00 | 4,625 % éch. 15/04/2033 | 4 079 | 4 440 | 0,01 |
| 6,560 % éch. 01/11/2028 | 552 | 550 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/02/2036 | 3 422 | 3 178 | 0,01 | 4,715 % éch. 15/07/2032 | 16 718 | 18 294 | 0,03 |
| 6,920 % éch. 01/12/2030 | 1 984 | 1 986 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/05/2036 | 193 | 187 | 0,00 | 4,752 % éch. 15/05/2032 | 9 275 | 10 102 | 0,02 |
| 7,060 % éch. 01/02/2031 | 1 285 | 1 144 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/12/2035 | 464 | 459 | 0,00 | 4,775 % éch. 15/01/2032 | 3 242 | 3 554 | 0,01 |
| 7,500 % éch. 01/03/2030 | 12 653 | 4 476 | 0,01 | 6,445 % éch. 25/01/2036 | 5 761 | 5 595 | 0,01 | 4,845 % éch. 15/04/2034 | 7 100 | 7 695 | 0,01 |
| 7,860 % éch. 01/03/2030 | 4 673 | 1 722 | 0,00 | 6,460 % éch. 25/02/2036 | 4 000 | 3 490 | 0,01 | 4,905 % éch. 15/01/2034 | 50 000 | 54 444 | 0,08 |
| Consoco Finance Securitizations Corp. | | | | 6,475 % éch. 25/10/2035 | 2 895 | 2 850 | 0,00 | Dryden Senior Loan Fund | | | |
| 7,100 % éch. 01/02/2033 | 58 | 58 | 0,00 | 6,535 % éch. 25/07/2035 | 1 973 | 1 957 | 0,00 | 6,625 % éch. 15/04/2031 | \$ 20 998 | 20 975 | 0,03 |
| 7,217 % éch. 01/09/2033 | 1 493 | 1 475 | 0,00 | 6,535 % éch. 25/08/2035 | 1 196 | 1 194 | 0,00 | ECMC Group Student Loan Trust | | | |
| 7,770 % éch. 01/09/2031 | 734 | 734 | 0,00 | 6,535 % éch. 25/10/2035 | 7 500 | 7 093 | 0,01 | 6,502 % éch. 25/05/2067 | 14 646 | 14 518 | 0,02 |
| 7,970 % éch. 01/05/2032 | 1 887 | 344 | 0,00 | 6,550 % éch. 25/05/2036 | 13 726 | 9 983 | 0,02 | Edsouth Indenture LLC | | | |
| 8,060 % éch. 01/09/2029 | 14 402 | 2 754 | 0,00 | 6,565 % éch. 25/07/2035 | 137 | 136 | 0,00 | 6,182 % éch. 25/04/2039 | 2 452 | 2 443 | 0,00 |
| 8,260 % éch. 01/12/2030 | 13 372 | 3 222 | 0,01 | 6,565 % éch. 25/04/2036 | 4 800 | 4 538 | 0,01 | EFS Volunteer LLC | | | |
| 8,310 % éch. 01/05/2032 | 20 172 | 3 832 | 0,01 | 6,595 % éch. 25/11/2035 | 270 | 264 | 0,00 | 6,446 % éch. 25/10/2035 | 318 | 318 | 0,00 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates | | | | 6,610 % éch. 25/01/2036 | 3 000 | 2 895 | 0,00 | Elevation CLO Ltd. | | | |
| 5,750 % éch. 25/03/2037 | 2 054 | 1 947 | 0,00 | 6,670 % éch. 25/11/2035 | 6 987 | 6 355 | 0,01 | 6,775 % éch. 15/07/2031 | 14 628 | 14 629 | 0,02 |
| 5,950 % éch. 25/04/2037 | 719 | 611 | 0,00 | 6,770 % éch. 25/10/2046 | 6 897 | 4 817 | 0,01 | 7,505 % éch. 15/07/2029 | 18 300 | 18 336 | 0,03 |
| 5,965 % éch. 25/03/2037 | 6 442 | 5 754 | 0,01 | 6,970 % éch. 25/10/2034 | 390 | 385 | 0,00 | Ellington Loan Acquisition Trust | | | |
| 5,970 % éch. 25/01/2046 | 11 308 | 10 578 | 0,02 | 6,970 % éch. 25/10/2047 | 5 000 | 3 498 | 0,01 | 6,520 % éch. 25/05/2037 | 9 477 | 9 211 | 0,01 |
| 6,220 % éch. 25/05/2034 | 147 | 143 | 0,00 | 7,120 % éch. 25/06/2035 | 1 694 | 1 664 | 0,00 | 6,570 % éch. 25/05/2037 | 12 053 | 11 694 | 0,02 |
| 6,370 % éch. 25/03/2047 | 1 474 | 1 127 | 0,00 | 7,420 % éch. 25/08/2035 | 4 950 | 4 542 | 0,01 | 6,970 % éch. 25/05/2037 | 1 474 | 1 438 | 0,00 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 7,570 % éch. 25/08/2035 | 605 | 473 | 0,00 | Encore Credit Receivables Trust | | | |
| 3,508 % éch. 25/04/2036 | 2 653 | 2 398 | 0,00 | 7,870 % éch. 25/10/2034 | 534 | 518 | 0,00 | 6,205 % éch. 25/07/2035 | 1 393 | 1 263 | 0,00 |
| 3,934 % éch. 25/03/2035 | 7 700 | 6 513 | 0,01 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. | | | | 6,370 % éch. 25/01/2036 | 828 | 787 | 0,00 |
| 3,934 % éch. 25/04/2035 | 1 043 | 1 018 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/10/2034 | 3 306 | 3 207 | 0,01 | 6,400 % éch. 25/11/2035 | 4 103 | 3 790 | 0,01 |
| 4,306 % éch. 25/01/2037 | 6 397 | 6 192 | 0,01 | 6,010 % éch. 25/12/2034 | 4 836 | 4 697 | 0,01 | 6,445 % éch. 25/01/2036 | 4 142 | 3 683 | 0,01 |
| 4,330 % éch. 25/11/2034 | 7 589 | 7 351 | 0,01 | 6,190 % éch. 25/07/2034 | 444 | 442 | 0,00 | 6,490 % éch. 25/07/2035 | 2 138 | 1 881 | 0,00 |
| 4,347 % éch. 25/10/2046 | 10 102 | 9 818 | 0,01 | 6,325 % éch. 25/08/2034 | 474 | 476 | 0,00 | EquiFirst Loan Securitization Trust | | | |
| 4,348 % éch. 25/12/2034 | 1 811 | 1 779 | 0,00 | Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc. | | | | 5,640 % éch. 25/04/2037 | 1 536 | 1 401 | 0,00 |
| 4,357 % éch. 25/01/2035 | 2 085 | 1 654 | 0,00 | 5,171 % éch. 25/03/2035 | 4 704 | 4 606 | 0,01 | EquiFirst Mortgage Loan Trust | | | |
| 4,486 % éch. 25/01/2037 | 13 000 | 11 491 | 0,02 | 6,210 % éch. 25/08/2047 | 12 056 | 11 513 | 0,02 | 7,270 % éch. 25/04/2035 | 1 091 | 935 | 0,00 |
| 4,512 % éch. 25/07/2036 | 4 485 | 4 041 | 0,01 | 6,220 % éch. 25/03/2034 | 2 636 | 2 618 | 0,00 | 8,095 % éch. 25/12/2034 | 657 | 563 | 0,00 |
| 4,877 % éch. 25/05/2036 | 23 145 | 22 451 | 0,03 | 6,970 % éch. 25/02/2035 | 5 197 | 5 108 | 0,01 | 8,845 % éch. 25/10/2034 | 1 104 | 1 052 | 0,00 |
| 5,115 % éch. 25/10/2035 | 1 250 | 1 102 | 0,00 | 7,270 % éch. 25/02/2035 | 5 032 | 4 292 | 0,01 | Equity One Mortgage Pass-Through Trust | | | |
| 5,348 % éch. 25/02/2036 | 6 262 | 5 260 | 0,01 | Countrywide Asset-Backed Securities Notes Trust | | | | 3,882 % éch. 25/07/2034 | 114 | 97 | 0,00 |
| 5,505 % éch. 25/07/2035 | 2 050 | 1 966 | 0,00 | 7,470 % éch. 25/08/2047 | 52 | 50 | 0,00 | FAB CBO BV | | | |
| 5,555 % éch. 25/07/2035 | 3 535 | 3 179 | 0,01 | Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust | | | | 4,941 % éch. 20/08/2080 | € 259 | 282 | 0,00 |
| 5,610 % éch. 25/06/2035 | 12 799 | 11 203 | 0,02 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Fidelity Grand Harbour CLO DAC | | | | 6,130 % éch. 25/12/2035 | \$ 1 707 | \$ 1 371 | 0,00 | 5,845 % éch. 25/10/2046 | \$ 6 000 | \$ 4 908 | 0,01 |
| 5,125 % éch. 15/03/2032 | € 5 196 | \$ 5 719 | 0,01 | GE-WMC Mortgage Securities Trust | | | | 5,950 % éch. 25/06/2036 | 1 998 | 1 054 | 0,00 |
| Fieldstone Mortgage Investment Trust | | | | 5,730 % éch. 25/08/2036 | 6 293 | 5 726 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/03/2046 | 201 | 195 | 0,00 |
| 5,697 % éch. 25/11/2036 | \$ 3 232 | 1 872 | 0,00 | Gilbert Park CLO Ltd. | | | | 5,990 % éch. 25/02/2046 | 736 | 684 | 0,00 |
| 5,737 % éch. 25/11/2036 | 6 968 | 6 236 | 0,01 | 6,845 % éch. 15/10/2030 | 12 744 | 12 731 | 0,02 | 6,010 % éch. 25/02/2036 | 552 | 525 | 0,00 |
| 5,850 % éch. 25/05/2036 | 6 655 | 4 636 | 0,01 | Golden Bar Securitisation SRL | | | | 6,055 % éch. 25/01/2036 | 120 | 123 | 0,00 |
| 5,937 % éch. 25/11/2036 | 2 584 | 1 496 | 0,00 | 6,816 % éch. 22/09/2043 | € 14 590 | 16 333 | 0,02 | 6,070 % éch. 25/01/2047 | 2 983 | 1 570 | 0,00 |
| 6,115 % éch. 25/02/2036 | 9 528 | 8 419 | 0,01 | 7,516 % éch. 22/09/2043 | 3 090 | 3 448 | 0,01 | 6,085 % éch. 25/01/2036 | 2 504 | 2 275 | 0,00 |
| 7,495 % éch. 25/02/2035 | 816 | 785 | 0,00 | GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC | | | | 6,115 % éch. 25/11/2035 | 4 170 | 3 735 | 0,01 |
| Finance America Mortgage Loan Trust | | | | 4,723 % éch. 20/10/2030 | 869 | 953 | 0,00 | 6,355 % éch. 25/07/2045 | 5 659 | 5 023 | 0,01 |
| 6,415 % éch. 25/11/2034 | 629 | 541 | 0,00 | GoldenTree Loan Opportunities Ltd. | | | | 6,370 % éch. 25/11/2035 | 3 622 | 3 424 | 0,01 |
| 6,490 % éch. 25/11/2034 | 459 | 359 | 0,00 | 6,797 % éch. 20/07/2031 | \$ 1 000 | 1 001 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/03/2035 | 1 099 | 1 023 | 0,00 |
| First Franklin Mortgage Loan Trust | | | | Golub Capital Partners CLO 26B Ltd. | | | | 6,445 % éch. 25/04/2035 | 1 921 | 1 783 | 0,00 |
| 4,757 % éch. 25/03/2036 | 1 180 | 1 171 | 0,00 | 6,697 % éch. 20/04/2031 | 16 298 | 16 318 | 0,02 | 6,520 % éch. 25/06/2034 | 455 | 430 | 0,00 |
| 5,585 % éch. 25/07/2036 | 1 054 | 1 005 | 0,00 | Goodgreen Trust | | | | 8,845 % éch. 25/02/2047 | 1 500 | 1 441 | 0,00 |
| 5,590 % éch. 25/11/2036 | 6 826 | 6 359 | 0,01 | 3,930 % éch. 15/10/2053 | 10 385 | 9 190 | 0,01 | Harvest CLO DAC | | | |
| 5,590 % éch. 25/12/2036 | 7 448 | 7 010 | 0,01 | Greenwood Park CLO Ltd. | | | | 4,815 % éch. 15/01/2032 | € 23 100 | 25 192 | 0,04 |
| 5,630 % éch. 25/10/2036 | 4 493 | 4 410 | 0,01 | 6,665 % éch. 15/04/2031 | 3 643 | 3 646 | 0,01 | 4,872 % éch. 18/11/2030 | 2 987 | 3 271 | 0,01 |
| 5,630 % éch. 25/11/2036 | 6 524 | 6 405 | 0,01 | Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. | | | | Hayfin Emerald CLO DAC | | | |
| 5,670 % éch. 25/03/2037 | 4 913 | 2 369 | 0,00 | 6,656 % éch. 15/09/2037 | 8 475 | 8 462 | 0,01 | 0,000 % éch. 25/01/2037 (c) | 22 600 | 24 965 | 0,04 |
| 5,690 % éch. 25/12/2037 | 520 | 491 | 0,00 | Griffith Park CLO DAC | | | | 5,660 % éch. 15/04/2035 | 21 000 | 23 372 | 0,03 |
| 5,750 % éch. 25/12/2036 | 13 424 | 5 484 | 0,01 | 4,704 % éch. 21/11/2031 | € 14 937 | 16 239 | 0,02 | Hildene TruPS Financials Note Securitization Ltd. | | | |
| 5,770 % éch. 25/08/2036 | 1 061 | 963 | 0,00 | GSAA Home Equity Trust | | | | 7,028 % éch. 10/10/2038 | \$ 21 856 | 21 092 | 0,03 |
| 5,770 % éch. 25/03/2037 | 619 | 300 | 0,00 | 5,558 % éch. 25/05/2035 | \$ 290 | 270 | 0,00 | Home Equity Asset Trust | | | |
| 5,780 % éch. 25/07/2036 | 4 053 | 3 882 | 0,01 | 5,570 % éch. 25/09/2036 | 4 003 | 893 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/11/2036 | 1 321 | 1 278 | 0,00 |
| 5,780 % éch. 25/09/2036 | 5 359 | 4 986 | 0,01 | 5,570 % éch. 25/12/2046 | 2 364 | 1 141 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/10/2036 | 3 813 | 2 292 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/04/2036 | 6 021 | 5 796 | 0,01 | 5,590 % éch. 25/05/2036 | 6 521 | 1 544 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/07/2036 | 3 250 | 2 964 | 0,01 |
| 5,790 % éch. 25/06/2036 | 5 257 | 5 102 | 0,01 | 5,590 % éch. 25/11/2036 | 5 010 | 1 170 | 0,00 | 6,130 % éch. 25/04/2036 | 2 529 | 2 305 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/12/2037 | 7 713 | 6 724 | 0,01 | 5,610 % éch. 25/12/2046 | 6 901 | 1 940 | 0,00 | 6,145 % éch. 25/02/2036 | 3 197 | 3 089 | 0,01 |
| 5,890 % éch. 25/12/2037 | 11 392 | 9 950 | 0,01 | 5,630 % éch. 25/02/2037 | 5 981 | 1 677 | 0,00 | 6,175 % éch. 25/01/2036 | 2 658 | 2 488 | 0,00 |
| 5,950 % éch. 25/08/2036 | 6 923 | 6 341 | 0,01 | 5,650 % éch. 25/07/2036 | 1 323 | 275 | 0,00 | 6,265 % éch. 25/11/2035 | 413 | 399 | 0,00 |
| 5,950 % éch. 25/10/2036 | 13 158 | 8 536 | 0,01 | 5,670 % éch. 25/03/2037 | 7 925 | 2 161 | 0,00 | 6,310 % éch. 25/01/2035 | 729 | 712 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 25/07/2035 | 1 057 | 1 041 | 0,00 | 5,676 % éch. 25/09/2035 | 3 225 | 2 101 | 0,00 | 6,325 % éch. 25/08/2034 | 88 | 87 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 25/02/2036 | 3 736 | 3 409 | 0,01 | 5,788 % éch. 25/05/2037 | 5 797 | 2 630 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/12/2034 | 22 | 21 | 0,00 |
| 6,145 % éch. 25/11/2035 | 1 222 | 1 196 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/06/2036 | 4 295 | 877 | 0,00 | 6,415 % éch. 25/11/2035 | 523 | 498 | 0,00 |
| 6,160 % éch. 25/01/2036 | 3 122 | 2 883 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/09/2036 | 5 447 | 1 221 | 0,00 | 6,415 % éch. 25/12/2035 | 620 | 575 | 0,00 |
| 6,190 % éch. 25/08/2034 | 848 | 783 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/03/2047 | 19 284 | 5 313 | 0,01 | 6,715 % éch. 25/05/2035 | 1 048 | 999 | 0,00 |
| 6,190 % éch. 25/11/2035 | 2 424 | 2 239 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/03/2036 | 11 367 | 3 815 | 0,01 | 6,970 % éch. 25/03/2035 | 867 | 818 | 0,00 |
| 6,220 % éch. 25/12/2035 | 3 866 | 3 721 | 0,01 | 5,830 % éch. 25/12/2036 | 13 040 | 3 507 | 0,01 | 7,120 % éch. 25/12/2034 | 575 | 560 | 0,00 |
| 6,280 % éch. 25/10/2035 | 3 347 | 3 609 | 0,01 | 5,850 % éch. 25/03/2036 | 8 195 | 2 901 | 0,00 | 7,170 % éch. 25/11/2034 | 608 | 596 | 0,00 |
| 6,295 % éch. 25/06/2034 | 193 | 192 | 0,00 | 5,917 % éch. 25/03/2037 | 2 302 | 459 | 0,00 | 7,220 % éch. 25/11/2034 | 297 | 288 | 0,00 |
| 6,415 % éch. 25/03/2035 | 652 | 641 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/11/2036 | 7 312 | 2 395 | 0,00 | Home Equity Loan Trust | | | |
| 6,415 % éch. 25/09/2035 | 4 052 | 3 588 | 0,01 | 5,970 % éch. 25/12/2035 | 4 051 | 2 279 | 0,00 | 5,700 % éch. 25/04/2037 | 387 | 374 | 0,00 |
| 6,745 % éch. 25/07/2034 | 1 581 | 1 551 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/10/2037 | 87 | 69 | 0,00 | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | |
| 6,895 % éch. 25/10/2034 | 364 | 364 | 0,00 | 6,032 % éch. 25/05/2037 | 4 519 | 2 049 | 0,00 | 5,590 % éch. 25/04/2037 | 5 561 | 3 830 | 0,01 |
| 7,270 % éch. 25/09/2034 | 1 708 | 1 732 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/03/2036 | 3 264 | 1 750 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/11/2036 | 5 059 | 4 622 | 0,01 |
| First NLC Trust | | | | 6,070 % éch. 25/03/2037 | 180 | 70 | 0,00 | 5,630 % éch. 25/11/2036 | 3 481 | 3 046 | 0,01 |
| 5,540 % éch. 25/08/2037 | 6 075 | 3 018 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/05/2047 | 107 | 65 | 0,00 | 5,640 % éch. 25/04/2037 | 9 848 | 6 784 | 0,01 |
| 5,610 % éch. 25/08/2037 | 183 | 91 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/10/2035 | 2 105 | 1 921 | 0,00 | 5,660 % éch. 25/04/2037 | 9 270 | 5 994 | 0,01 |
| 5,650 % éch. 25/08/2037 | 3 295 | 1 638 | 0,00 | 6,205 % éch. 25/06/2035 | 2 019 | 1 944 | 0,00 | 5,660 % éch. 25/07/2037 | 7 811 | 3 150 | 0,01 |
| 5,750 % éch. 25/08/2037 | 46 | 23 | 0,00 | 6,230 % éch. 25/01/2036 | 465 | 38 | 0,00 | 5,670 % éch. 25/07/2037 | 9 099 | 4 919 | 0,01 |
| 6,205 % éch. 25/02/2036 | 4 467 | 3 727 | 0,01 | 6,300 % éch. 25/03/2037 | 5 586 | 1 337 | 0,00 | 5,680 % éch. 25/04/2037 | 1 197 | 825 | 0,00 |
| Fremont Home Loan Trust | | | | 6,376 % éch. 25/09/2036 | 698 | 184 | 0,00 | 5,710 % éch. 25/11/2036 | 602 | 465 | 0,00 |
| 5,600 % éch. 25/11/2036 | 5 198 | 1 801 | 0,00 | 6,415 % éch. 25/08/2035 | 2 004 | 1 811 | 0,00 | 5,710 % éch. 25/04/2037 | 10 086 | 6 523 | 0,01 |
| 5,605 % éch. 25/10/2036 | 11 389 | 10 001 | 0,02 | 6,459 % éch. 25/09/2036 | 4 674 | 1 232 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/06/2036 | 2 682 | 2 497 | 0,00 |
| 5,610 % éch. 25/01/2037 | 20 977 | 10 339 | 0,02 | 6,483 % éch. 25/03/2037 | 5 207 | 1 558 | 0,00 | 5,850 % éch. 25/06/2036 | 38 | 37 | 0,00 |
| 5,620 % éch. 25/10/2036 | 12 368 | 4 996 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/10/2037 | 1 122 | 635 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/08/2036 | 4 884 | 4 334 | 0,01 |
| 5,670 % éch. 25/08/2036 | 6 641 | 2 137 | 0,00 | 6,599 % éch. 25/03/2037 | 2 068 | 493 | 0,00 | 6,130 % éch. 25/03/2036 | 4 756 | 4 334 | 0,01 |
| 5,690 % éch. 25/11/2036 | 6 564 | 2 275 | 0,00 | GSAMP Trust | | | | 6,535 % éch. 25/08/2035 | 1 800 | 1 724 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/02/2037 | 12 646 | 9 682 | 0,01 | 3,689 % éch. 25/11/2034 | 1 219 | 1 145 | 0,00 | 6,715 % éch. 25/03/2035 | 2 748 | 2 675 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/05/2036 | 7 695 | 4 490 | 0,01 | 5,520 % éch. 25/12/2046 | 299 | 148 | 0,00 | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | |
| 5,810 % éch. 25/02/2036 | 3 751 | 3 555 | 0,01 | 5,570 % éch. 25/12/2046 | 1 343 | 666 | 0,00 | 5,620 % éch. 25/12/2036 | 2 456 | 2 197 | 0,00 |
| 6,010 % éch. 25/02/2036 | 300 | 255 | 0,00 | 5,590 % éch. 25/12/2036 | 4 869 | 2 297 | 0,00 | 5,660 % éch. 25/01/2037 | 12 954 | 9 015 | 0,01 |
| 6,085 % éch. 25/11/2035 | 5 829 | 5 111 | 0,01 | 5,600 % éch. 25/12/2046 | 5 153 | 2 756 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/12/2036 | 15 535 | 6 666 | 0,01 |
| 6,130 % éch. 25/01/2036 | 1 242 | 1 174 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/11/2036 | 4 786 | 2 307 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/04/2037 | 11 604 | 5 979 | 0,01 |
| 6,145 % éch. 25/01/2036 | 6 546 | 4 996 | 0,01 | 5,610 % éch. 25/03/2047 | 6 201 | 5 565 | 0,01 | 5,790 % éch. 25/10/2036 | 18 299 | 7 400 | 0,01 |
| 6,150 % éch. 25/11/2035 | 188 | 185 | 0,00 | 5,620 % éch. 25/12/2046 | 453 | 225 | 0,00 | 5,845 % éch. 25/05/2037 | 4 026 | 3 886 | 0,01 |
| 6,180 % éch. 25/06/2035 | 4 251 | 4 077 | 0,01 | 5,630 % éch. 25/08/2036 | 2 171 | 1 692 | 0,00 | 5,910 % éch. 25/12/2036 | 17 556 | 4 651 | 0,01 |
| 6,220 % éch. 25/06/2035 | 1 036 | 1 007 | 0,00 | 5,630 % éch. 25/01/2037 | 15 080 | 8 695 | 0,01 | 5,995 % éch. 25/02/2036 | 3 065 | 2 534 | 0,00 |
| 6,250 % éch. 25/07/2035 | 1 909 | 1 780 | 0,00 | 5,640 % éch. 25/12/2036 | 7 127 | 3 363 | 0,01 | 6,010 % éch. 25/12/2035 | 147 | 146 | 0,00 |
| 6,340 % éch. 25/05/2034 | 865 | 815 | 0,00 | 5,640 % éch. 25/01/2037 | 4 461 | 4 323 | 0,01 | 6,055 % éch. 25/12/2035 | 4 450 | 4 168 | 0,00 |
| 6,400 % éch. 25/07/2035 | 2 103 | 1 616 | 0,00 | 5,670 % éch. 25/11/2036 | 1 168 | 555 | 0,00 | 6,085 % éch. 25/01/2036 | 8 126 | 7 500 | 0,01 |
| 6,490 % éch. 25/01/2035 | 2 590 | 2 176 | 0,00 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Invesco Euro CLO DAC | | | | 5,670 % éch. 25/07/2036 | \$ 6 237 | \$ 2 443 | 0,00 | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust | | | |
| 4,905 % éch. 15/07/2034 | € 40 000 | \$ 43 417 | 0,06 | 5,690 % éch. 25/11/2036 | 322 | 100 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/04/2037 | \$ 641 | \$ 275 | 0,00 |
| IXIS Real Estate Capital Trust | | | | 5,710 % éch. 25/08/2036 | 19 089 | 7 577 | 0,01 | 5,830 % éch. 25/06/2037 | 653 | 501 | 0,00 |
| 5,530 % éch. 25/05/2037 | \$ 21 093 | 5 019 | 0,01 | 5,760 % éch. 25/07/2036 | 4 828 | 3 371 | 0,01 | 6,150 % éch. 25/04/2037 | 11 592 | 4 616 | 0,01 |
| 5,770 % éch. 25/01/2037 | 13 908 | 4 973 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/05/2036 | 9 433 | 5 083 | 0,01 | 6,470 % éch. 25/10/2037 | 6 790 | 5 620 | 0,01 |
| 5,790 % éch. 25/08/2036 | 3 182 | 904 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/09/2036 | 2 425 | 955 | 0,00 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | |
| 5,870 % éch. 25/03/2036 | 1 389 | 723 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/11/2036 | 849 | 543 | 0,00 | 4,330 % éch. 25/11/2037 | 7 806 | 3 858 | 0,01 |
| Jamestown CLO Ltd. | | | | 5,790 % éch. 25/11/2036 | 14 756 | 10 578 | 0,02 | 4,471 % éch. 25/11/2037 | 3 494 | 1 219 | 0,00 |
| 6,790 % éch. 25/04/2030 | 23 593 | 23 559 | 0,03 | 5,790 % éch. 25/05/2036 | 11 064 | 3 308 | 0,01 | 5,690 % éch. 25/07/2037 | 6 005 | 2 615 | 0,00 |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. | | | | 5,790 % éch. 25/08/2036 | 2 425 | 965 | 0,00 | 5,710 % éch. 25/02/2037 | 3 920 | 1 178 | 0,00 |
| 3,110 % éch. 25/10/2035 | 4 669 | 4 078 | 0,01 | 5,790 % éch. 25/09/2036 | 10 357 | 2 888 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/05/2037 | 5 084 | 2 592 | 0,00 |
| 5,980 % éch. 25/02/2036 | 2 289 | 2 243 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/10/2036 | 28 477 | 9 024 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/06/2037 | 3 559 | 883 | 0,00 |
| 6,010 % éch. 25/02/2036 | 2 711 | 2 331 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/12/2036 | 22 530 | 15 386 | 0,02 | 5,770 % éch. 25/08/2037 | 13 899 | 9 479 | 0,01 |
| 6,010 % éch. 25/03/2036 | 6 003 | 5 746 | 0,01 | 5,790 % éch. 25/05/2046 | 11 920 | 11 069 | 0,02 | 5,790 % éch. 25/03/2037 | 10 088 | 9 003 | 0,01 |
| 6,055 % éch. 25/05/2035 | 1 041 | 1 022 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/12/2036 | 84 | 30 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/07/2037 | 2 892 | 1 644 | 0,00 |
| 6,100 % éch. 25/05/2035 | 5 614 | 5 199 | 0,01 | 5,830 % éch. 25/03/2046 | 19 060 | 15 271 | 0,02 | 5,850 % éch. 25/04/2047 | 6 197 | 2 525 | 0,00 |
| 6,175 % éch. 25/09/2035 | 181 | 179 | 0,00 | 5,850 % éch. 25/03/2046 | 2 677 | 965 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/07/2037 | 3 435 | 822 | 0,00 |
| 6,220 % éch. 25/06/2035 | 4 027 | 3 908 | 0,01 | 5,930 % éch. 25/12/2036 | 1 398 | 501 | 0,00 | 5,990 % éch. 25/03/2037 | 2 607 | 725 | 0,00 |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | | 5,950 % éch. 25/08/2036 | 2 989 | 1 196 | 0,00 | 5,990 % éch. 25/07/2037 | 5 245 | 2 323 | 0,00 |
| 4,258 % éch. 25/07/2036 | 1 786 | 1 745 | 0,00 | 5,990 % éch. 25/08/2045 | 523 | 507 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/12/2036 | 2 393 | 2 254 | 0,00 |
| 4,433 % éch. 25/11/2036 | 4 112 | 3 702 | 0,01 | 6,030 % éch. 25/10/2034 | 4 508 | 4 311 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/01/2037 | 5 003 | 4 556 | 0,01 |
| 4,470 % éch. 25/01/2037 | 2 176 | 1 151 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/01/2036 | 13 493 | 12 200 | 0,02 | 6,370 % éch. 25/02/2047 | 206 | 122 | 0,00 |
| 4,724 % éch. 25/11/2036 | 6 434 | 6 495 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/02/2036 | 11 683 | 9 365 | 0,01 | 6,400 % éch. 25/07/2035 | 2 945 | 2 921 | 0,00 |
| 5,550 % éch. 25/12/2036 | 3 007 | 1 599 | 0,00 | 6,250 % éch. 25/08/2035 | 6 618 | 6 468 | 0,01 | 6,475 % éch. 25/06/2036 | 3 274 | 2 546 | 0,00 |
| 5,620 % éch. 25/12/2036 | 5 493 | 2 942 | 0,01 | 6,265 % éch. 25/06/2034 | 2 065 | 2 030 | 0,00 | 6,550 % éch. 25/10/2035 | 114 | 114 | 0,00 |
| 5,650 % éch. 25/07/2036 | 500 | 211 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/06/2035 | 4 897 | 4 724 | 0,01 | 6,595 % éch. 25/08/2036 | 1 330 | 1 357 | 0,00 |
| 5,660 % éch. 25/03/2047 | 1 020 | 1 013 | 0,00 | 6,595 % éch. 25/04/2035 | 2 500 | 2 377 | 0,00 | METAL Cayman Ltd. | | | |
| 5,680 % éch. 25/10/2036 | 3 096 | 3 042 | 0,01 | 6,620 % éch. 25/09/2034 | 1 014 | 1 017 | 0,00 | 4,581 % éch. 15/10/2042 | 24 392 | 15 123 | 0,02 |
| 5,680 % éch. 25/12/2036 | 5 495 | 2 957 | 0,01 | 6,895 % éch. 25/02/2035 | 6 008 | 5 551 | 0,01 | MKS CLO Ltd. | | | |
| 5,700 % éch. 25/05/2037 | 2 290 | 2 199 | 0,00 | Madison Park Euro Funding DAC | | | | 6,867 % éch. 20/01/2031 | 29 741 | 29 771 | 0,04 |
| 5,710 % éch. 25/05/2037 | 5 475 | 5 424 | 0,01 | 4,696 % éch. 25/10/2030 | € 2 681 | 2 919 | 0,00 | MMcapS Funding Ltd. | | | |
| 5,730 % éch. 25/03/2037 | 2 551 | 2 486 | 0,00 | 4,715 % éch. 15/01/2032 | 18 100 | 19 703 | 0,03 | 5,989 % éch. 01/12/2035 | 2 762 | 2 638 | 0,00 |
| 5,730 % éch. 25/06/2037 | 926 | 925 | 0,00 | Madison Park Funding Ltd. | | | | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | |
| 5,740 % éch. 25/08/2036 | 6 700 | 6 090 | 0,01 | 0,000 % éch. 29/07/2030 | \$ 15 779 | 15 780 | 0,02 | 3,938 % éch. 25/01/2035 | 1 822 | 1 618 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/01/2037 | 437 | 422 | 0,00 | 6,405 % éch. 15/04/2030 | 9 768 | 9 732 | 0,01 | 5,540 % éch. 25/10/2036 | 2 823 | 1 470 | 0,00 |
| 5,770 % éch. 25/03/2037 | 7 847 | 7 214 | 0,01 | 6,707 % éch. 20/04/2030 | 3 571 | 3 569 | 0,01 | 5,550 % éch. 25/11/2036 | 5 099 | 2 899 | 0,00 |
| 5,875 % éch. 25/05/2036 | 2 126 | 2 061 | 0,00 | Magnetite Ltd. | | | | 5,560 % éch. 25/01/2037 | 15 768 | 7 001 | 0,01 |
| 5,875 % éch. 25/07/2036 | 2 838 | 2 759 | 0,00 | 6,777 % éch. 18/10/2031 | 5 225 | 5 226 | 0,01 | 5,570 % éch. 25/07/2036 | 6 425 | 2 374 | 0,00 |
| 5,905 % éch. 25/05/2036 | 4 653 | 4 375 | 0,01 | Man GLG Euro CLO DAC | | | | 5,570 % éch. 25/10/2036 | 1 337 | 577 | 0,00 |
| 5,905 % éch. 25/07/2036 | 144 | 140 | 0,00 | 4,645 % éch. 15/10/2030 | € 5 362 | 5 886 | 0,01 | 5,570 % éch. 25/11/2036 | 4 733 | 2 692 | 0,00 |
| 5,920 % éch. 25/07/2036 | 3 786 | 3 267 | 0,01 | 4,705 % éch. 15/10/2030 | 11 277 | 12 365 | 0,02 | 5,580 % éch. 25/10/2036 | 5 060 | 2 639 | 0,00 |
| 5,980 % éch. 25/04/2036 | 4 745 | 3 976 | 0,01 | 4,775 % éch. 15/10/2032 | 7 161 | 7 815 | 0,01 | 5,580 % éch. 25/12/2036 | 3 615 | 1 838 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/01/2037 | 4 943 | 4 303 | 0,01 | 4,835 % éch. 15/01/2030 | 6 556 | 7 239 | 0,01 | 5,580 % éch. 25/02/2037 | 3 246 | 1 051 | 0,00 |
| 6,040 % éch. 25/07/2036 | 1 800 | 1 732 | 0,00 | 5,779 % éch. 15/10/2036 | 22 120 | 24 492 | 0,04 | 5,580 % éch. 25/03/2037 | 420 | 180 | 0,00 |
| 6,130 % éch. 25/07/2036 | 1 998 | 1 792 | 0,00 | MAPS Ltd. | | | | 5,600 % éch. 25/01/2037 | 96 | 43 | 0,00 |
| 6,630 % éch. 25/07/2036 | 9 767 | 2 838 | 0,00 | 4,212 % éch. 15/05/2043 | \$ 15 204 | 13 648 | 0,02 | 5,600 % éch. 25/02/2037 | 72 | 64 | 0,00 |
| Jubilee CLO DAC | | | | Marlay Park CLO DAC | | | | 5,610 % éch. 25/10/2036 | 16 853 | 7 277 | 0,01 |
| 4,756 % éch. 26/07/2030 | € 10 000 | 10 927 | 0,02 | 4,705 % éch. 15/10/2030 | € 2 648 | 2 906 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/05/2037 | 23 280 | 18 451 | 0,03 |
| KKR CLO Ltd. | | | | MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | | 5,620 % éch. 25/11/2036 | 6 926 | 3 943 | 0,01 |
| 6,785 % éch. 16/10/2030 | \$ 2 262 | 2 264 | 0,00 | 5,520 % éch. 25/10/2036 | \$ 5 114 | 1 686 | 0,00 | 5,620 % éch. 25/12/2036 | 10 688 | 5 436 | 0,01 |
| 6,835 % éch. 15/01/2031 | 2 173 | 2 173 | 0,00 | 5,570 % éch. 25/11/2036 | 101 | 32 | 0,00 | 5,620 % éch. 25/02/2037 | 4 764 | 2 258 | 0,00 |
| Kodiak CDO Ltd. | | | | 5,615 % éch. 25/01/2037 | 22 031 | 6 195 | 0,01 | 5,650 % éch. 25/02/2037 | 1 942 | 630 | 0,00 |
| 6,112 % éch. 07/08/2037 | 1 977 | 1 918 | 0,00 | 5,620 % éch. 25/10/2036 | 6 755 | 2 244 | 0,00 | 5,670 % éch. 25/05/2037 | 6 807 | 3 926 | 0,01 |
| LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd. | | | | 5,670 % éch. 25/08/2036 | 8 282 | 3 044 | 0,01 | 5,680 % éch. 25/01/2037 | 5 026 | 2 234 | 0,00 |
| 6,735 % éch. 16/07/2031 | 11 426 | 11 427 | 0,02 | 5,670 % éch. 25/10/2036 | 5 333 | 2 659 | 0,00 | 5,720 % éch. 25/07/2036 | 7 916 | 6 950 | 0,01 |
| LCM LP | | | | 5,680 % éch. 25/05/2037 | 5 928 | 5 638 | 0,01 | 5,720 % éch. 25/12/2036 | 0 | 0 | 0,00 |
| 6,697 % éch. 20/04/2031 | 40 373 | 40 422 | 0,06 | 5,690 % éch. 25/11/2036 | 6 888 | 2 214 | 0,00 | 5,720 % éch. 25/03/2037 | 5 220 | 2 238 | 0,00 |
| 6,785 % éch. 15/10/2031 | 49 300 | 49 248 | 0,07 | 5,730 % éch. 25/10/2036 | 502 | 229 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/02/2037 | 823 | 390 | 0,00 |
| Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust | | | | 5,740 % éch. 25/08/2036 | 7 324 | 2 886 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/06/2036 | 3 626 | 1 890 | 0,00 |
| 6,630 % éch. 15/04/2040 | 2 364 | 2 381 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/04/2036 | 4 169 | 984 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 3 401 | 1 271 | 0,00 |
| Lehman XS Trust | | | | 5,770 % éch. 25/06/2036 | 3 478 | 1 257 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/09/2036 | 4 022 | 1 720 | 0,00 |
| 4,555 % éch. 25/06/2036 | 5 | 5 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/08/2036 | 13 951 | 5 023 | 0,01 | 5,800 % éch. 25/02/2037 | 12 455 | 5 905 | 0,01 |
| 5,011 % éch. 25/01/2036 | 1 977 | 1 738 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/10/2036 | 6 982 | 3 481 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/06/2036 | 21 422 | 14 408 | 0,02 |
| 5,670 % éch. 25/02/2037 | 9 770 | 8 731 | 0,01 | 5,910 % éch. 25/11/2036 | 9 259 | 5 477 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/09/2036 | 24 476 | 8 708 | 0,01 |
| 5,780 % éch. 25/03/2037 | 2 324 | 2 031 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/03/2036 | 2 947 | 1 810 | 0,00 | 5,965 % éch. 25/03/2036 | 5 666 | 4 707 | 0,01 |
| 5,790 % éch. 25/05/2036 | 3 042 | 2 627 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/06/2036 | 208 | 76 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/04/2036 | 8 518 | 7 993 | 0,01 |
| 5,810 % éch. 25/10/2036 | 1 630 | 1 475 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/08/2036 | 4 016 | 1 499 | 0,00 | 5,970 % éch. 25/07/2036 | 1 614 | 609 | 0,00 |
| 5,810 % éch. 25/12/2036 | 3 786 | 3 522 | 0,01 | 5,970 % éch. 25/11/2035 | 2 563 | 1 471 | 0,00 | 6,040 % éch. 25/12/2035 | 87 | 84 | 0,00 |
| 5,890 % éch. 25/06/2046 | 4 262 | 3 853 | 0,01 | 6,040 % éch. 25/01/2036 | 2 118 | 2 080 | 0,00 | 6,040 % éch. 25/12/2035 | 5 111 | 4 139 | 0,01 |
| 5,930 % éch. 25/02/2037 | 4 660 | 3 473 | 0,01 | 6,050 % éch. 25/01/2036 | 420 | 413 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/12/2035 | 3 500 | 3 211 | 0,01 |
| 5,990 % éch. 25/05/2046 | 1 501 | 1 312 | 0,00 | 6,170 % éch. 25/09/2034 | 1 995 | 1 838 | 0,00 | 6,130 % éch. 25/01/2035 | 2 814 | 2 767 | 0,00 |
| 5,990 % éch. 25/02/2047 | 1 904 | 1 696 | 0,00 | 6,220 % éch. 25/10/2035 | 4 632 | 4 335 | 0,01 | 6,130 % éch. 25/11/2035 | 6 152 | 5 883 | 0,01 |
| 6,050 % éch. 25/09/2036 | 3 417 | 2 951 | 0,00 | 6,250 % éch. 25/11/2035 | 1 675 | 73 | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 6,400 % éch. 25/02/2035 | \$ 2 224 | 1 985 | 0,00 | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | \$ 8 985 | 7 156 | 0,01 | 6,205 % éch. 25/09/2035 | \$ 5 868 | 5 663 | 0,01 |
| 6,415 % éch. 25/01/2035 | 3 746 | 3 339 | 0,01 | 5,750 % éch. 25/07/2036 | 1 963 | 1 850 | 0,00 | 6,265 % éch. 25/07/2035 | 2 450 | 2 415 | 0,00 |
| 6,470 % éch. 25/07/2037 | 5 069 | 4 951 | 0,01 | 5,950 % éch. 25/03/2036 | 4 902 | 4 450 | 0,01 | 6,445 % éch. 25/07/2035 | 5 600 | 4 191 | 0,01 |
| 6,520 % éch. 25/04/2035 | 1 890 | 1 792 | 0,00 | 5,965 % éch. 25/03/2036 | 3 903 | 3 722 | 0,01 | 6,475 % éch. 25/06/2035 | 2 888 | 2 703 | 0,00 |
| 6,520 % éch. 25/06/2035 | 2 755 | 2 442 | 0,00 | 6,130 % éch. 25/11/2035 | 7 070 | 1 577 | 0,00 | 6,505 % éch. 25/05/2035 | 3 000 | 2 390 | 0,00 |
| 6,720 % éch. 25/07/2037 | 8 600 | 7 246 | 0,01 | 6,130 % éch. 25/10/2036 | 2 136 | 2 097 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/09/2034 | 2 493 | 2 462 | 0,00 |
| 7,270 % éch. 25/05/2034 | 277 | 269 | 0,00 | 6,235 % éch. 25/05/2035 | 9 740 | 2 856 | 0,00 | 6,520 % éch. 25/06/2035 | 1 992 | 1 600 | 0,00 |
| 8,095 % éch. 25/03/2034 | 794 | 804 | 0,00 | 6,270 % éch. 25/02/2037 | 5 210 | 1 432 | 0,00 | 6,595 % éch. 25/03/2035 | 722 | 701 | 0,00 |
| Morgan Stanley Capital, Inc. Trust | | | | 6,492 % éch. 25/02/2037 | 2 638 | 619 | 0,00 | 6,790 % éch. 25/01/2036 | 5 451 | 5 071 | 0,01 |
| 6,010 % éch. 25/02/2036 | 3 571 | 3 236 | 0,01 | 6,532 % éch. 25/10/2036 | 12 500 | 13 665 | 0,02 | 7,045 % éch. 25/02/2035 | 7 209 | 6 909 | 0,01 |
| 6,010 % éch. 25/03/2036 | 9 137 | 7 272 | 0,01 | North Westerly ESG CLO DAC | | | | 7,240 % éch. 25/10/2034 | 5 729 | 5 359 | 0,01 |
| 6,025 % éch. 25/01/2036 | 2 869 | 2 292 | 0,00 | 4,972 % éch. 05/07/2032 | € 11 026 | 11 047 | 0,02 | 7,270 % éch. 25/12/2034 | 8 508 | 8 390 | 0,01 |
| 6,050 % éch. 25/01/2036 | 1 847 | 1 772 | 0,00 | Northwoods Capital Ltd. | | | | 7,345 % éch. 25/12/2034 | 5 706 | 5 194 | 0,01 |
| 6,050 % éch. 25/02/2036 | 212 | 209 | 0,00 | 7,246 % éch. 15/06/2031 | \$ 5 700 | 5 334 | 0,01 | 7,570 % éch. 25/09/2034 | 107 | 92 | 0,00 |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | Penta CLO DAC | | | |
| 5,640 % éch. 25/04/2037 | 16 106 | 8 380 | 0,01 | 2,907 % éch. 25/01/2036 | 3 045 | 1 025 | 0,00 | 4,906 % éch. 25/01/2033 | € 64 000 | 69 734 | 0,10 |
| 5,790 % éch. 25/04/2036 | 6 642 | 4 763 | 0,01 | 5,620 % éch. 25/03/2037 | 26 180 | 8 809 | 0,01 | People's Choice Home Loan Securities Trust | | | |
| 5,820 % éch. 25/04/2037 | 204 | 107 | 0,00 | 5,650 % éch. 25/03/2037 | 3 655 | 3 340 | 0,01 | 6,150 % éch. 25/12/2035 | \$ 4 957 | 4 748 | 0,01 |
| 5,980 % éch. 25/02/2036 | 5 534 | 5 035 | 0,01 | 5,670 % éch. 25/09/2037 | 9 191 | 8 887 | 0,01 | 6,325 % éch. 25/08/2035 | 4 075 | 3 871 | 0,01 |
| Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust | | | | 5,770 % éch. 25/09/2036 | 2 780 | 1 977 | 0,00 | 6,415 % éch. 25/05/2035 | 610 | 556 | 0,00 |
| 5,520 % éch. 25/11/2036 | 1 | 0 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/09/2036 | 5 963 | 2 487 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/02/2036 | 7 624 | 4 589 | 0,01 |
| 5,540 % éch. 25/11/2036 | 6 879 | 2 308 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/05/2036 | 2 647 | 2 603 | 0,00 | People's Financial Realty Mortgage Securities Trust | | | |
| 5,620 % éch. 25/11/2036 | 5 657 | 1 899 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/11/2036 | 1 253 | 378 | 0,00 | 5,710 % éch. 25/09/2036 | 10 692 | 1 994 | 0,00 |
| 5,690 % éch. 25/11/2036 | 1 548 | 520 | 0,00 | 5,810 % éch. 25/01/2037 | 18 759 | 6 626 | 0,01 | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust | | | |
| 5,770 % éch. 25/07/2036 | 13 528 | 5 451 | 0,01 | 6,010 % éch. 25/05/2036 | 400 | 377 | 0,00 | 3,428 % éch. 25/11/2035 | 174 | 172 | 0,00 |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | 6,175 % éch. 25/01/2036 | 729 | 720 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/11/2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,630 % éch. 25/11/2036 | 1 376 | 393 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/10/2035 | 1 947 | 1 923 | 0,00 | 5,780 % éch. 25/06/2047 | 868 | 801 | 0,00 |
| 5,710 % éch. 25/04/2037 | 14 708 | 4 115 | 0,01 | 6,205 % éch. 25/01/2036 | 5 000 | 4 740 | 0,01 | 5,917 % éch. 25/04/2035 | 2 290 | 2 205 | 0,00 |
| 5,810 % éch. 25/10/2036 | 8 027 | 2 336 | 0,00 | 6,295 % éch. 25/06/2034 | 1 863 | 1 804 | 0,00 | 5,965 % éch. 25/07/2036 | 2 144 | 1 998 | 0,00 |
| 5,810 % éch. 25/11/2036 | 4 477 | 1 277 | 0,00 | 7,195 % éch. 25/12/2034 | 770 | 680 | 0,00 | 6,055 % éch. 25/02/2036 | 704 | 697 | 0,00 |
| 5,810 % éch. 25/01/2047 | 3 702 | 1 132 | 0,00 | 7,345 % éch. 25/03/2035 | 2 489 | 2 447 | 0,00 | Pretium Mortgage Credit Partners LLC | | | |
| 5,950 % éch. 25/04/2037 | 3 527 | 988 | 0,00 | Oakwood Mortgage Investors, Inc. | | | | 2,240 % éch. 27/09/2060 | 9 534 | 9 582 | 0,01 |
| 6,010 % éch. 25/04/2037 | 15 569 | 5 619 | 0,01 | 5,050 % éch. 15/11/2019 | 122 | 115 | 0,00 | Project Silver | | | |
| 6,070 % éch. 25/02/2037 | 3 909 | 2 209 | 0,00 | OCP Euro CLO DAC | € 5 931 | 6 518 | 0,01 | 3,967 % éch. 15/07/2044 | 15 811 | 13 276 | 0,02 |
| 6,077 % éch. 25/10/2046 | 4 311 | 1 066 | 0,00 | 4,775 % éch. 15/01/2032 | € 5 011 | 929 | 0,00 | RAAC Trust | | | |
| 6,190 % éch. 25/04/2037 | 3 421 | 958 | 0,00 | Option One Mortgage Loan Trust | | | | 5,970 % éch. 25/02/2037 | 2 408 | 2 317 | 0,00 |
| 6,263 % éch. 25/01/2047 | 1 227 | 378 | 0,00 | 5,570 % éch. 25/07/2036 | \$ 5 540 | 5 260 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/06/2044 | 1 146 | 965 | 0,00 |
| 6,298 % éch. 25/10/2036 | 8 705 | 1 978 | 0,00 | 5,590 % éch. 25/03/2037 | 10 744 | 6 837 | 0,01 | 6,120 % éch. 25/06/2047 | 2 343 | 2 266 | 0,00 |
| 6,326 % éch. 25/09/2046 | 11 401 | 2 526 | 0,00 | 5,600 % éch. 25/07/2037 | 5 610 | 10 249 | 0,02 | 6,160 % éch. 25/11/2036 | 71 | 69 | 0,00 |
| 6,488 % éch. 25/11/2036 | 6 239 | 1 458 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/01/2037 | 19 312 | 12 528 | 0,02 | 6,230 % éch. 25/10/2046 | 1 857 | 1 779 | 0,00 |
| 6,592 % éch. 25/10/2036 | 1 780 | 577 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/02/2037 | 14 014 | 7 849 | 0,01 | 6,325 % éch. 25/03/2037 | 607 | 605 | 0,00 |
| Mountain View CLO LLC | | | | 5,640 % éch. 25/03/2037 | 19 446 | 10 413 | 0,02 | 6,670 % éch. 25/10/2045 | 0 | 0 | 0,00 |
| 6,745 % éch. 16/10/2029 | 19 315 | 19 321 | 0,03 | 5,640 % éch. 25/05/2037 | 655 | 312 | 0,00 | Raptor Aircraft Finance LLC | | | |
| Nassau Ltd. | | | | 5,650 % éch. 25/04/2037 | 4 470 | 2 844 | 0,00 | 4,213 % éch. 23/08/2044 | 45 081 | 36 328 | 0,05 |
| 6,805 % éch. 15/10/2029 | 3 501 | 3 501 | 0,01 | 5,660 % éch. 25/07/2037 | 1 910 | 1 649 | 0,00 | Regatta Funding Ltd. | | | |
| 6,805 % éch. 15/07/2031 | 41 812 | 41 815 | 0,06 | 5,670 % éch. 25/07/2036 | 10 106 | 5 683 | 0,01 | 6,914 % éch. 17/10/2030 | 2 274 | 2 273 | 0,00 |
| 6,905 % éch. 15/01/2030 | 23 775 | 23 808 | 0,03 | 5,690 % éch. 25/01/2037 | 7 078 | 4 015 | 0,01 | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | |
| National Collegiate Student Loan Trust | | | | 5,690 % éch. 25/04/2037 | 32 938 | 22 577 | 0,03 | 5,285 % éch. 25/01/2037 | 2 814 | 945 | 0,00 |
| 5,780 % éch. 25/05/2032 | 5 085 | 4 911 | 0,01 | 5,690 % éch. 25/05/2037 | 4 860 | 2 879 | 0,00 | 5,294 % éch. 25/01/2037 | 18 457 | 6 206 | 0,01 |
| 5,790 % éch. 27/10/2031 | 7 184 | 7 060 | 0,01 | 5,720 % éch. 25/03/2037 | 2 473 | 1 206 | 0,00 | 5,434 % éch. 25/08/2035 | 1 580 | 1 571 | 0,00 |
| 5,820 % éch. 25/03/2033 | 6 700 | 6 359 | 0,01 | 6,010 % éch. 25/01/2036 | 19 098 | 17 389 | 0,03 | 5,512 % éch. 25/04/2037 | 8 724 | 2 322 | 0,00 |
| 5,840 % éch. 25/06/2033 | 2 209 | 2 106 | 0,00 | 6,205 % éch. 25/05/2035 | 2 810 | 2 656 | 0,00 | 5,545 % éch. 25/01/2037 | 2 529 | 891 | 0,00 |
| Nationstar Home Equity Loan Trust | | | | 6,265 % éch. 25/05/2034 | 1 838 | 1 783 | 0,00 | 5,608 % éch. 25/05/2036 | 6 712 | 3 202 | 0,01 |
| 5,645 % éch. 25/06/2037 | 5 049 | 4 868 | 0,01 | 6,340 % éch. 25/05/2035 | 700 | 586 | 0,00 | 5,612 % éch. 25/04/2037 | 5 992 | 1 624 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/04/2037 | 6 915 | 6 766 | 0,01 | 6,400 % éch. 25/08/2035 | 490 | 396 | 0,00 | 5,675 % éch. 25/06/2037 | 421 | 111 | 0,00 |
| Navigant Private Education Loan Trust | | | | Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates | | | | 5,731 % éch. 25/11/2036 | 4 836 | 1 732 | 0,00 |
| 4,100 % éch. 16/12/2058 | 3 860 | 3 719 | 0,01 | 6,160 % éch. 25/11/2035 | 2 466 | 2 327 | 0,00 | 5,742 % éch. 25/04/2037 | 19 235 | 5 334 | 0,01 |
| 6,926 % éch. 16/07/2040 | 10 798 | 10 842 | 0,02 | Owinit Mortgage Loan Trust | | | | 5,744 % éch. 25/06/2037 | 5 934 | 1 590 | 0,00 |
| 7,626 % éch. 15/12/2045 | 4 785 | 4 812 | 0,01 | 3,192 % éch. 25/12/2035 | 1 676 | 958 | 0,00 | 5,746 % éch. 25/05/2036 | 2 134 | 1 043 | 0,00 |
| Nelnet Student Loan Trust | | | | 5,690 % éch. 25/07/2037 | 1 117 | 949 | 0,00 | 5,761 % éch. 25/04/2037 | 2 781 | 774 | 0,00 |
| 5,910 % éch. 27/09/2066 | 27 492 | 27 394 | 0,04 | OZLM Ltd. | | | | 5,762 % éch. 25/08/2036 | 8 258 | 3 295 | 0,01 |
| New Century Home Equity Loan Trust | | | | 6,727 % éch. 20/04/2031 | 1 427 | 1 427 | 0,00 | 5,797 % éch. 25/08/2036 | 12 841 | 5 155 | 0,01 |
| 5,790 % éch. 25/08/2036 | 5 705 | 5 493 | 0,01 | OZLME DAC | | | | 5,812 % éch. 25/11/2036 | 8 748 | 3 176 | 0,01 |
| 5,830 % éch. 25/05/2036 | 1 017 | 1 001 | 0,00 | 4,723 % éch. 24/08/2030 | € 2 113 | 2 312 | 0,00 | 5,857 % éch. 25/05/2035 | 2 027 | 1 681 | 0,00 |
| 6,115 % éch. 25/12/2035 | 7 106 | 6 740 | 0,01 | Palmer Square CLO Ltd. | | | | 5,879 % éch. 25/06/2037 | 2 974 | 816 | 0,00 |
| 6,145 % éch. 25/03/2035 | 1 545 | 1 554 | 0,00 | 6,794 % éch. 17/01/2031 | \$ 584 | 585 | 0,00 | 5,893 % éch. 25/06/2037 | 28 633 | 7 876 | 0,01 |
| 6,190 % éch. 25/03/2035 | 4 567 | 4 487 | 0,01 | Palmer Square European CLO DAC | | | | 5,906 % éch. 25/06/2037 | 7 657 | 2 111 | 0,00 |
| 6,205 % éch. 25/10/2035 | 6 885 | 5 820 | 0,01 | 1,970 % éch. 15/04/2035 | € 6 000 | 5 838 | 0,01 | 6,011 % éch. 25/05/2036 | 3 091 | 1 578 | 0,00 |
| 6,235 % éch. 25/02/2035 | 3 486 | 3 369 | 0,01 | Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | 6,120 % éch. 25/11/2036 | 11 903 | 4 547 | 0,01 |
| 6,355 % éch. 25/08/2034 | 424 | 418 | 0,00 | 0,000 % éch. 15/05/2033 | 26 600 | 29 312 | 0,04 | 6,166 % éch. 25/05/2036 | 3 374 | 1 765 | 0,00 |
| 6,400 % éch. 25/11/2034 | 2 796 | 2 737 | 0,00 | 5,602 % éch. 15/11/2032 | 34 369 | 37 961 | 0,05 | 6,210 % éch. 25/08/2035 | 2 697 | 2 402 | 0,00 |
| 6,415 % éch. 25/06/2035 | 438 | 441 | 0,00 | Park Place Securities, Inc. | | | | 6,230 % éch. 25/12/2032 | 41 | 37 | 0,00 |
| 6,415 % éch. 25/09/2035 | 7 903 | 7 711 | 0,01 | 6,205 % éch. 25/09/2035 | \$ 5 589 | 5 463 | 0,01 | 6,511 % éch. 25/07/2034 | 989 | 832 | 0,00 |
| 6,445 % éch. 25/11/2034 | 204 | 202 | 0,00 | 6,415 % éch. 25/09/2035 | 2 506 | 2 203 | 0,00 | 6,998 % éch. 25/09/2037 | 9 273 | 3 954 | 0,01 |
| 6,445 % éch. 25/06/2035 | 4 903 | 4 849 | 0,01 | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 7,238 % éch. 25/09/2037 | 9 441 | 4 023 | 0,01 |
| 6,475 % éch. 25/07/2035 | 11 261 | 11 002 | 0,02 | 6,205 % éch. 25/08/2035 | 6 007 | 5 845 | 0,01 | Residential Asset Mortgage Products Trust | | | |
| 6,535 % éch. 25/03/2035 | 342 | 332 | 0,00 | | | | | 0,000 % éch. 25/12/2035 | 533 | 440 | 0,00 |
| Newcastle Mortgage Securities Trust | | | | | | | | 5,820 % éch. 25/10/2036 | 4 022 | 3 825 | 0,01 |
| 5,660 % éch. 25/04/2037 | 2 364 | 2 247 | 0,00 | | | | | 5,980 % éch. 25/03/2036 | 1 061 | 1 029 | 0,00 |
| 5,700 % éch. 25/04/2037 | 9 103 | 8 894 | 0,01 | | | | | 6,010 % éch. 25/02/ | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR | JUSTE | EN % | DESCRIPTION | VALEUR | JUSTE | EN % | DESCRIPTION | VALEUR | JUSTE | EN % |
|---|---------------|---------------|------|--|---------------|---------------|------|---|---------------|---------------|------|
| | NOMINALE | VALEUR | DE | | NOMINALE | VALEUR | DE | | NOMINALE | VALEUR | DE |
| | (en milliers) | (en milliers) | NET | | (en milliers) | (en milliers) | NET | | (en milliers) | (en milliers) | NET |
| 6,115 % éch. 25/02/2036 | \$ 500 | \$ 475 | 0,00 | 5,600 % éch. 25/05/2037 | \$ 8 | \$ 6 | 0,00 | 6,160 % éch. 25/12/2035 | \$ 8 776 | \$ 7 973 | 0,01 |
| 6,150 % éch. 25/12/2035 | 4 854 | 4 257 | 0,01 | 5,630 % éch. 25/08/2036 | 2 739 | 890 | 0,00 | 6,220 % éch. 25/01/2035 | 450 | 410 | 0,00 |
| 6,170 % éch. 25/08/2035 | 1 865 | 1 812 | 0,00 | 5,670 % éch. 25/05/2037 | 4 792 | 2 908 | 0,00 | 6,310 % éch. 25/08/2035 | 4 301 | 3 847 | 0,01 |
| 6,250 % éch. 25/07/2035 | 95 | 94 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/12/2036 | 12 712 | 2 900 | 0,00 | 6,370 % éch. 25/10/2037 | 16 155 | 12 691 | 0,02 |
| 6,250 % éch. 25/09/2035 | 1 533 | 1 428 | 0,00 | 5,730 % éch. 25/12/2036 | 6 853 | 6 202 | 0,01 | 6,400 % éch. 25/11/2035 | 41 | 41 | 0,00 |
| 6,415 % éch. 25/10/2035 | 2 384 | 1 981 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/05/2036 | 7 344 | 3 851 | 0,01 | 6,420 % éch. 25/09/2037 | 1 664 | 1 331 | 0,00 |
| 6,445 % éch. 25/07/2035 | 1 906 | 1 773 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/06/2036 | 1 823 | 1 181 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/03/2036 | 2 722 | 2 478 | 0,00 |
| 6,490 % éch. 25/05/2035 | 740 | 732 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/09/2036 | 3 954 | 3 589 | 0,01 | 6,470 % éch. 25/09/2037 | 4 071 | 2 830 | 0,00 |
| 6,535 % éch. 25/05/2035 | 2 096 | 1 980 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/01/2037 | 6 063 | 5 265 | 0,01 | 6,505 % éch. 25/05/2035 | 607 | 600 | 0,00 |
| 6,595 % éch. 25/06/2035 | 2 600 | 2 509 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/03/2036 | 2 569 | 1 573 | 0,00 | 6,550 % éch. 25/07/2035 | 467 | 462 | 0,00 |
| 6,670 % éch. 25/01/2035 | 2 266 | 2 110 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/09/2036 | 5 730 | 2 008 | 0,00 | 6,570 % éch. 25/09/2037 | 1 503 | 1 202 | 0,00 |
| Residential Asset Securities Corp. Trust | | | | 5,770 % éch. 25/12/2036 | 540 | 280 | 0,00 | Southern Pacific Secured Asset Corp. | | | |
| 5,453 % éch. 25/04/2034 | 439 | 426 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/09/2036 | 1 606 | 1 077 | 0,00 | 5,870 % éch. 25/03/2028 | 60 | 56 | 0,00 |
| 5,678 % éch. 25/01/2037 | 6 370 | 5 399 | 0,01 | 5,790 % éch. 25/10/2036 | 1 068 | 360 | 0,00 | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust | | | |
| 5,690 % éch. 25/02/2037 | 6 524 | 6 256 | 0,01 | 5,810 % éch. 25/08/2036 | 12 117 | 3 936 | 0,01 | 5,590 % éch. 25/04/2037 | 736 | 503 | 0,00 |
| 5,712 % éch. 25/06/2034 | 1 719 | 1 688 | 0,00 | 5,910 % éch. 25/01/2037 | 1 035 | 753 | 0,00 | 5,670 % éch. 25/04/2037 | 2 772 | 1 906 | 0,00 |
| 5,730 % éch. 25/07/2036 | 14 | 14 | 0,00 | 5,950 % éch. 25/07/2036 | 7 336 | 2 541 | 0,00 | 5,690 % éch. 25/09/2037 | 3 187 | 1 040 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 25/07/2036 | 3 837 | 3 670 | 0,01 | 6,010 % éch. 25/03/2036 | 463 | 415 | 0,00 | 5,750 % éch. 25/09/2037 | 6 979 | 6 247 | 0,01 |
| 5,750 % éch. 25/09/2036 | 3 150 | 3 076 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/11/2035 | 3 509 | 2 882 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/06/2037 | 1 790 | 1 030 | 0,00 |
| 5,810 % éch. 25/04/2037 | 6 342 | 5 997 | 0,01 | 6,115 % éch. 25/10/2035 | 2 216 | 1 754 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/11/2037 | 8 617 | 4 721 | 0,01 |
| 5,905 % éch. 25/06/2036 | 3 157 | 3 060 | 0,01 | 6,145 % éch. 25/01/2035 | 516 | 452 | 0,00 | 5,820 % éch. 25/10/2037 | 1 501 | 818 | 0,00 |
| 5,910 % éch. 25/01/2037 | 3 566 | 3 362 | 0,01 | 6,190 % éch. 25/10/2035 | 1 750 | 1 446 | 0,00 | 5,820 % éch. 25/04/2037 | 396 | 275 | 0,00 |
| 5,980 % éch. 25/04/2036 | 4 426 | 4 026 | 0,01 | 6,355 % éch. 25/10/2035 | 2 927 | 2 454 | 0,00 | 6,445 % éch. 25/12/2035 | 1 231 | 1 212 | 0,00 |
| 6,010 % éch. 25/07/2036 | 2 325 | 2 031 | 0,00 | 6,430 % éch. 25/01/2036 | 594 | 540 | 0,00 | 6,640 % éch. 25/12/2035 | 852 | 821 | 0,00 |
| 6,030 % éch. 25/04/2036 | 1 140 | 1 126 | 0,00 | Segovia European CLO DAC | | | | St. Paul's CLO DAC | | | |
| 6,055 % éch. 25/03/2036 | 2 180 | 2 150 | 0,00 | 4,873 % éch. 20/07/2032 | € 4 600 | 5 017 | 0,01 | 4,885 % éch. 15/04/2033 | € 1 200 | 1 310 | 0,00 |
| 6,070 % éch. 25/02/2036 | 1 348 | 1 327 | 0,00 | SG Mortgage Securities Trust | | | | START Ltd. | | | |
| 6,085 % éch. 25/11/2035 | 94 | 88 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/07/2036 | \$ 23 025 | 5 008 | 0,01 | 4,089 % éch. 15/03/2044 | \$ 11 771 | 10 704 | 0,02 |
| 6,100 % éch. 25/02/2036 | 2 810 | 2 671 | 0,00 | 5,830 % éch. 25/02/2036 | 3 578 | 1 784 | 0,00 | Starwood Commercial Mortgage Trust | | | |
| 6,115 % éch. 25/03/2035 | 72 | 71 | 0,00 | 6,010 % éch. 25/02/2036 | 1 882 | 949 | 0,00 | 6,556 % éch. 15/07/2038 | 10 193 | 10 086 | 0,02 |
| 6,130 % éch. 25/11/2035 | 294 | 293 | 0,00 | 6,175 % éch. 25/10/2035 | 921 | 824 | 0,00 | 6,876 % éch. 15/07/2038 | 14 830 | 14 314 | 0,02 |
| 6,130 % éch. 25/12/2035 | 3 988 | 3 833 | 0,01 | 6,355 % éch. 25/10/2035 | 1 083 | 845 | 0,00 | 7,076 % éch. 15/07/2038 | 5 930 | 5 531 | 0,01 |
| 6,150 % éch. 25/05/2037 | 1 074 | 1 052 | 0,00 | Signal Peak CLO Ltd. | | | | Steele Creek CLO Ltd. | | | |
| 6,160 % éch. 25/11/2035 | 598 | 594 | 0,00 | 6,750 % éch. 25/04/2031 | 11 956 | 11 973 | 0,02 | 6,744 % éch. 21/04/2031 | 10 924 | 10 940 | 0,02 |
| 6,175 % éch. 25/09/2035 | 838 | 787 | 0,00 | SLM Private Credit Student Loan Trust | | | | 6,905 % éch. 15/10/2030 | 2 227 | 2 226 | 0,00 |
| 6,175 % éch. 25/10/2035 | 2 047 | 1 720 | 0,00 | 5,976 % éch. 15/06/2039 | 12 502 | 12 119 | 0,02 | Structured Asset Investment Loan Trust | | | |
| 6,175 % éch. 25/11/2035 | 476 | 457 | 0,00 | SLM Student Loan Trust | | | | 5,600 % éch. 25/07/2036 | 699 | 506 | 0,00 |
| 6,190 % éch. 25/01/2036 | 4 882 | 4 742 | 0,01 | 4,356 % éch. 25/10/2039 | € 2 118 | 2 182 | 0,00 | 5,620 % éch. 25/07/2036 | 2 055 | 1 992 | 0,00 |
| 6,340 % éch. 25/11/2035 | 3 825 | 3 077 | 0,01 | 4,475 % éch. 15/12/2033 | 8 971 | 9 183 | 0,01 | 5,643 % éch. 25/07/2036 | 15 257 | 9 131 | 0,01 |
| 6,430 % éch. 25/08/2035 | 2 568 | 2 524 | 0,00 | 4,506 % éch. 25/07/2039 | 11 859 | 12 331 | 0,02 | 5,790 % éch. 25/05/2036 | 77 | 75 | 0,00 |
| 6,505 % éch. 25/10/2035 | 2 013 | 1 908 | 0,00 | 4,506 % éch. 25/01/2040 | 24 600 | 24 843 | 0,04 | 5,850 % éch. 25/03/2036 | 1 333 | 1 296 | 0,00 |
| 6,715 % éch. 25/03/2035 | 1 010 | 967 | 0,00 | 6,252 % éch. 25/03/2026 | \$ 14 151 | 14 009 | 0,02 | 6,020 % éch. 25/09/2034 | 3 891 | 3 659 | 0,01 |
| 7,270 % éch. 25/04/2035 | 653 | 635 | 0,00 | 6,346 % éch. 25/04/2023 | 7 141 | 7 089 | 0,01 | 6,070 % éch. 25/04/2036 | 8 610 | 4 561 | 0,01 |
| 7,420 % éch. 25/11/2034 | 994 | 971 | 0,00 | 7,296 % éch. 25/07/2023 | 6 179 | 6 181 | 0,01 | 6,090 % éch. 25/01/2036 | 3 615 | 3 328 | 0,01 |
| Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust | | | | SMB Private Education Loan Trust | | | | 6,100 % éch. 25/11/2035 | 6 171 | 5 933 | 0,01 |
| 5,400 % éch. 25/12/2035 | 1 548 | 238 | 0,00 | 3,500 % éch. 16/12/2041 | 4 000 | 3 707 | 0,01 | 6,175 % éch. 25/03/2034 | 140 | 137 | 0,00 |
| Rockford Tower CLO Ltd. | | | | 6,276 % éch. 15/02/2036 | 1 067 | 1 059 | 0,00 | 6,190 % éch. 25/04/2033 | 498 | 497 | 0,00 |
| 6,729 % éch. 20/05/2031 | 10 073 | 10 066 | 0,02 | SoFi Alternative Trust | | | | 6,190 % éch. 25/04/2035 | 2 312 | 2 258 | 0,00 |
| 6,837 % éch. 20/10/2031 | 10 200 | 10 198 | 0,02 | 5,203 % éch. 15/06/2050 | 14 450 | 13 977 | 0,02 | 6,190 % éch. 25/07/2035 | 262 | 244 | 0,00 |
| Romark WM-R Ltd. | | | | 5,219 % éch. 16/05/2050 | 15 188 | 14 812 | 0,02 | 6,190 % éch. 25/09/2035 | 2 516 | 2 468 | 0,00 |
| 6,707 % éch. 20/04/2031 | 26 346 | 26 350 | 0,04 | Solosso CDO Ltd. | | | | 6,190 % éch. 25/10/2035 | 104 | 101 | 0,00 |
| RRE Loan Management DAC | | | | 5,928 % éch. 07/10/2037 | 3 701 | 3 460 | 0,01 | 6,190 % éch. 25/01/2036 | 3 745 | 3 569 | 0,01 |
| 5,005 % éch. 15/10/2036 | € 3 500 | 3 803 | 0,01 | Sound Point CLO Ltd. | | | | 6,220 % éch. 25/07/2035 | 1 459 | 1 391 | 0,00 |
| RYE Harbour CLO DAC | | | | 6,797 % éch. 21/01/2031 | 15 523 | 15 509 | 0,02 | 6,235 % éch. 25/08/2035 | 1 972 | 1 891 | 0,00 |
| 4,902 % éch. 21/01/2031 | 4 040 | 4 442 | 0,01 | Sound Point Euro CLO Funding DAC | | | | 6,370 % éch. 25/05/2035 | 3 567 | 3 477 | 0,01 |
| Sapphire Aviation Finance Ltd. | | | | 5,065 % éch. 15/01/2035 | € 43 500 | 47 599 | 0,07 | 6,400 % éch. 25/01/2035 | 4 134 | 4 009 | 0,01 |
| 4,250 % éch. 15/03/2040 | \$ 17 042 | 15 194 | 0,02 | Soundview Home Loan Trust | | | | 6,400 % éch. 25/06/2035 | 5 218 | 4 943 | 0,01 |
| Saranac CLO Ltd. | | | | 5,550 % éch. 25/06/2037 | \$ 3 153 | 2 082 | 0,00 | 6,470 % éch. 25/09/2034 | 3 135 | 3 053 | 0,01 |
| 7,233 % éch. 22/06/2030 | 19 029 | 19 058 | 0,03 | 5,590 % éch. 25/11/2036 | 8 636 | 2 610 | 0,00 | 6,595 % éch. 25/07/2033 | 362 | 362 | 0,00 |
| Saxon Asset Securities Trust | | | | 5,620 % éch. 25/03/2037 | 4 766 | 4 436 | 0,01 | 6,670 % éch. 25/12/2034 | 331 | 330 | 0,00 |
| 1,458 % éch. 25/11/2035 | 5 217 | 4 685 | 0,01 | 5,620 % éch. 25/06/2037 | 16 727 | 11 046 | 0,02 | 6,745 % éch. 25/12/2034 | 1 302 | 1 256 | 0,00 |
| 2,011 % éch. 25/05/2035 | 3 689 | 3 287 | 0,01 | 5,630 % éch. 25/01/2037 | 8 626 | 6 146 | 0,01 | 6,850 % éch. 25/04/2033 | 13 | 12 | 0,00 |
| 4,129 % éch. 25/08/2035 | 3 323 | 3 301 | 0,01 | 5,640 % éch. 25/07/2037 | 737 | 630 | 0,00 | 6,970 % éch. 25/11/2034 | 616 | 628 | 0,00 |
| 5,650 % éch. 25/05/2037 | 2 485 | 1 739 | 0,00 | 5,640 % éch. 25/08/2037 | 7 878 | 6 652 | 0,01 | Structured Asset Securities Corp. | | | |
| 5,670 % éch. 25/05/2047 | 8 473 | 7 399 | 0,01 | 5,650 % éch. 25/07/2037 | 6 156 | 5 315 | 0,01 | 4,819 % éch. 25/02/2035 | 1 505 | 1 510 | 0,00 |
| 5,710 % éch. 25/10/2046 | 16 837 | 13 914 | 0,02 | 5,670 % éch. 25/02/2037 | 32 906 | 10 392 | 0,02 | 6,610 % éch. 25/02/2035 | 584 | 571 | 0,00 |
| 5,780 % éch. 25/09/2037 | 8 792 | 8 298 | 0,01 | 5,670 % éch. 25/06/2037 | 21 678 | 15 278 | 0,02 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,870 % éch. 25/09/2047 | 3 355 | 3 065 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 41 | 41 | 0,00 | 5,033 % éch. 25/08/2034 | 59 | 57 | 0,00 |
| 5,920 % éch. 25/09/2036 | 6 922 | 5 577 | 0,01 | 5,770 % éch. 25/01/2037 | 3 400 | 3 199 | 0,01 | 5,620 % éch. 25/04/2036 | 2 109 | 2 069 | 0,00 |
| 5,960 % éch. 25/09/2047 | 5 418 | 4 385 | 0,01 | 5,810 % éch. 25/11/2036 | 5 349 | 1 616 | 0,00 | 5,625 % éch. 25/09/2036 | 9 267 | 5 753 | 0,01 |
| 6,130 % éch. 25/10/2035 | 3 340 | 3 133 | 0,01 | 5,875 % éch. 25/12/2036 | 5 746 | 5 604 | 0,01 | 5,630 % éch. 25/01/2037 | 7 735 | 7 261 | 0,01 |
| 6,190 % éch. 25/11/2037 | 2 500 | 2 047 | 0,00 | 5,890 % éch. 25/06/2036 | 4 682 | 3 847 | 0,01 | 5,640 % éch. 25/01/2037 | 827 | 827 | 0,00 |
| 6,445 % éch. 26/12/2034 | 629 | 548 | 0,00 | 5,920 % éch. 25/05/2036 | 8 967 | 7 322 | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) \$ | JUSTE VALEUR (en milliers) \$ | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) \$ | JUSTE VALEUR (en milliers) \$ | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) \$ | JUSTE VALEUR (en milliers) \$ | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|---|--|------------------------------|--|---|--|------------------------------|---|---|--|------------------------------|
| 5,810 % éch. 25/12/2036 | 491 | 479 | 0,00 | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust | 792 | 589 | 0,00 | 3,000 % éch. | | | |
| 5,890 % éch. 25/02/2037 | 161 | 155 | 0,00 | Wellfleet CLO Ltd. | | | | 03/12/2026 (h) MXN | 844 054 | 46 302 | 0,07 |
| 5,900 % éch. 25/03/2037 | 3 743 | 2 768 | 0,00 | 6,927 % éch. 20/01/2032 | 400 | 399 | 0,00 | 4,000 % éch. | | | |
| 5,970 % éch. 25/11/2037 | 18 208 | 13 714 | 0,02 | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | | 30/11/2028 (h) | 3 053 841 | 176 351 | 0,25 |
| 5,995 % éch. 25/07/2036 | 1 471 | 1 402 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/07/2036 | 3 200 | 3 061 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement péruvien | | | |
| 6,090 % éch. 25/12/2036 | 13 350 | 7 600 | 0,01 | 5,815 % éch. 25/01/2037 | 3 450 | 3 330 | 0,01 | 5,350 % éch. 12/08/2040 PEN | 2 300 | 533 | 0,00 |
| 6,090 % éch. 25/02/2037 | 4 331 | 4 140 | 0,01 | 5,890 % éch. 25/03/2037 | 1 416 | 1 392 | 0,00 | 5,400 % éch. 12/08/2034 | 121 | 30 | 0,00 |
| 6,145 % éch. 25/04/2035 | 113 | 102 | 0,00 | 5,930 % éch. 25/04/2037 | 1 993 | 1 927 | 0,00 | 5,940 % éch. 12/02/2029 | 13 761 | 3 716 | 0,01 |
| 6,145 % éch. 25/06/2035 | 107 | 101 | 0,00 | 5,980 % éch. 25/05/2036 | 3 877 | 3 788 | 0,01 | 6,150 % éch. 12/08/2032 | 12 060 | 3 185 | 0,00 |
| 6,370 % éch. 25/08/2037 | 2 470 | 2 442 | 0,00 | 6,070 % éch. 25/04/2037 | 1 000 | 681 | 0,00 | 6,900 % éch. 12/08/2037 | 7 647 | 2 082 | 0,00 |
| 6,400 % éch. 25/05/2035 | 357 | 352 | 0,00 | 6,470 % éch. 25/10/2034 | 745 | 739 | 0,00 | 6,950 % éch. 12/08/2031 | 30 370 | 8 482 | 0,01 |
| 6,475 % éch. 25/11/2035 | 1 000 | 985 | 0,00 | 7,195 % éch. 25/11/2035 | 3 238 | 3 215 | 0,01 | Provincia de Buenos Aires | | | |
| 7,495 % éch. 25/07/2035 | 1 430 | 1 476 | 0,00 | 7,570 % éch. 25/11/2035 | 2 472 | 2 391 | 0,00 | 129,126 % éch. | | | |
| 7,570 % éch. 25/11/2035 | 129 | 124 | 0,00 | 7,870 % éch. 25/12/2034 | 1 435 | 1 416 | 0,00 | 12/04/2025 (a) ARS | 3 331 617 | 2 780 | 0,00 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates | | | | 8,020 % éch. 25/04/2035 | 542 | 555 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement de la République hellénique | | | |
| 6,295 % éch. 25/01/2035 | 438 | 437 | 0,00 | 9,220 % éch. 25/04/2035 | 1 147 | 1 218 | 0,00 | 3,750 % éch. 30/01/2028 | € 4 618 | 5 350 | 0,01 |
| Structured Asset Securities Corp. Trust | | | | Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates | | | | 3,900 % éch. 30/01/2033 | 9 948 | 11 702 | 0,02 |
| 5,740 % éch. 25/05/2031 | 318 | 222 | 0,00 | 6,210 % éch. 25/04/2034 | 192 | 185 | 0,00 | 4,000 % éch. 30/01/2037 | 6 211 | 7 256 | 0,01 |
| 7,099 % éch. 25/05/2031 | 1 197 | 929 | 0,00 | Whitehorse Ltd. | | | | 4,200 % éch. 30/01/2042 | 3 488 | 4 125 | 0,01 |
| Symphony CLO Ltd. | | | | 6,905 % éch. 15/10/2031 | 21 200 | 21 232 | 0,03 | Obligation internationale du gouvernement roumain | | | |
| 6,535 % éch. 15/04/2028 | 991 | 992 | 0,00 | Wind River CLO Ltd. | | | | 1,750 % éch. 13/07/2030 | 2 600 | 2 329 | 0,00 |
| Taberna Preferred Funding Ltd. | | | | 6,707 % éch. 18/07/2031 | 13 304 | 13 301 | 0,02 | 2,000 % éch. 14/04/2033 | 11 400 | 9 454 | 0,01 |
| 5,994 % éch. 05/05/2038 | 4 921 | 4 675 | 0,01 | 6,779 % éch. 20/11/2030 | 2 050 | 2 048 | 0,00 | 2,125 % éch. 07/03/2028 | 3 100 | 3 115 | 0,00 |
| 6,014 % éch. 05/12/2036 | 23 162 | 20 266 | 0,03 | | | | | 2,750 % éch. 14/04/2041 | 30 800 | 22 922 | 0,03 |
| 6,084 % éch. 05/11/2035 | 14 418 | 13 409 | 0,02 | | | | | 3,750 % éch. 07/02/2034 | 14 300 | 13 629 | 0,02 |
| 6,146 % éch. 05/07/2035 | 8 313 | 7 565 | 0,01 | | | | | 5,500 % éch. 18/09/2028 | 98 000 | 111 484 | 0,16 |
| Terwin Mortgage Trust | | | | | | | | 6,375 % éch. 18/09/2033 | 98 000 | 114 681 | 0,16 |
| 4,395 % éch. 25/08/2036 | 1 084 | 199 | 0,00 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Obligation internationale du gouvernement russe | | | |
| 5,810 % éch. 25/07/2037 | 4 663 | 4 477 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement argentin | | | | 1,850 % éch. 20/11/2032 ^ | 2 800 | 1 059 | 0,00 |
| 6,270 % éch. 25/09/2036 | 3 125 | 1 342 | 0,00 | 0,750 % éch. 09/07/2030 | 312 485 | 122 580 | 0,17 | 4,250 % éch. 23/06/2027 ^ \$ | 116 200 | 74 949 | 0,11 |
| 6,410 % éch. 25/11/2033 | 6 | 5 | 0,00 | 1,000 % éch. 09/07/2029 | 18 219 | 7 274 | 0,01 | 4,375 % éch. 21/03/2029 ^ | 6 000 | 3 390 | 0,01 |
| TIAA CLO Ltd. | | | | 3,500 % éch. 09/07/2041 | 198 256 | 67 727 | 0,10 | 4,750 % éch. 27/05/2026 ^ | 115 600 | 81 498 | 0,12 |
| 6,805 % éch. 16/01/2031 | 8 998 | 9 001 | 0,01 | 3,625 % éch. 09/07/2035 | 278 448 | 93 215 | 0,13 | 5,100 % éch. 28/03/2035 ^ | 20 000 | 8 100 | 0,01 |
| TICP CLO Ltd. | | | | 3,625 % éch. 09/07/2046 | 8 050 | 2 789 | 0,00 | 5,250 % éch. 23/06/2047 ^ | 345 400 | 122 617 | 0,17 |
| 6,817 % éch. 20/01/2031 | 10 419 | 10 433 | 0,02 | 4,250 % éch. 09/01/2038 | 115 791 | 46 032 | 0,07 | 5,625 % éch. 04/04/2042 ^ | 98 400 | 66 164 | 0,09 |
| Tikehau CLO BV | | | | Obligation internationale du gouvernement australien | | | | 5,875 % éch. 16/09/2043 ^ | 26 600 | 16 806 | 0,02 |
| 4,948 % éch. 07/09/2035 | € 5 800 | 6 272 | 0,01 | 1,750 % éch. 21/06/2051 AUD | 204 800 | 82 618 | 0,12 | 7,150 % éch. 12/11/2025 ^ RUB | 20 520 713 | 94 111 | 0,13 |
| Tikehau CLO DAC | | | | Ville autonome de Buenos Aires | | | | 7,500 % éch. 31/03/2030 ^ \$ | 16 872 | 11 059 | 0,02 |
| 5,065 % éch. 15/04/2032 | 15 000 | 16 449 | 0,02 | 113,333 % éch. | | | | 7,950 % éch. 07/10/2026 ^ RUB | 7 973 492 | 32 777 | 0,05 |
| Toro European CLO DAC | | | | 29/03/2024 (a) ARS | 1 | 0 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | |
| 4,705 % éch. 15/10/2030 | 1 113 | 1 220 | 0,00 | 122,642 % éch. | | | | 10,500 % éch. 21/12/2021 ZAR | 11 472 400 | 656 745 | 0,93 |
| 4,885 % éch. 15/07/2030 | 907 | 1 003 | 0,00 | 22/02/2028 (a) | 766 034 | 675 | 0,00 | State Agency of Roads of Ukraine | | | |
| Tralee CLO Ltd. | | | | Export-Credit Bank of Turkey | | | | 6,250 % éch. 24/06/2030 \$ | 1 500 | 386 | 0,00 |
| 7,577 % éch. 20/07/2029 | \$ 16 550 | 16 585 | 0,02 | 8,250 % éch. 24/01/2024 \$ | 13 400 | 13 430 | 0,02 | Obligation internationale du gouvernement turc | | | |
| Trapeza CDO Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement israélien | | | | 4,250 % éch. 13/03/2025 | 201 100 | 197 722 | 0,28 |
| 5,907 % éch. 09/11/2042 | 602 | 554 | 0,00 | 3,800 % éch. 13/05/2060 | 161 411 | 116 209 | 0,16 | 5,250 % éch. 13/03/2030 | 155 000 | 142 619 | 0,20 |
| 5,974 % éch. 06/04/2042 | 5 935 | 5 312 | 0,01 | 4,500 % éch. 03/04/2120 | 4 400 | 3 453 | 0,01 | 6,125 % éch. 24/10/2028 | 28 900 | 28 488 | 0,04 |
| 6,008 % éch. 10/10/2041 | 3 704 | 3 241 | 0,01 | 5,000 % éch. 30/10/2026 € | 739 900 | 836 489 | 1,19 | 7,625 % éch. 26/04/2029 | 94 000 | 97 532 | 0,14 |
| 6,024 % éch. 06/07/2041 | 8 699 | 7 481 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | | | | | |
| 6,084 % éch. 06/07/2041 | 9 000 | 6 750 | 0,01 | 2,750 % éch. | | | | | | | |
| Tropic CDO Ltd. | | | | 27/11/2031 (h) MXN | 4 990 177 | 260 207 | 0,37 | | | | |
| 5,975 % éch. 15/07/2036 | 12 653 | 11 704 | 0,02 | | | | | | | | |
| 6,405 % éch. 15/04/2034 | 117 | 117 | 0,00 | | | | | | | | |
| Truman Capital Mortgage Loan Trust | | | | | | | | | | | |
| 5,950 % éch. 25/03/2036 | 1 294 | 1 152 | 0,00 | | | | | | | | |
| TruPS Financials Note Securitization Ltd. | | | | | | | | | | | |
| 6,762 % éch. 30/03/2039 | 28 348 | 27 710 | 0,04 | | | | | | | | |
| 7,202 % éch. 20/09/2039 | 6 656 | 6 323 | 0,01 | | | | | | | | |
| Tymon Park CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,952 % éch. 21/07/2034 | € 4 600 | 4 983 | 0,01 | | | | | | | | |
| Venture CLO Ltd. | | | | | | | | | | | |
| 6,535 % éch. 15/04/2027 | \$ 11 014 | 11 012 | 0,02 | | | | | | | | |
| 6,915 % éch. 15/01/2032 | 8 000 | 7 985 | 0,01 | | | | | | | | |
| 7,333 % éch. 10/09/2029 | 4 950 | 4 957 | 0,01 | | | | | | | | |
| Vesey Park CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,947 % éch. 16/11/2032 | € 4 500 | 4 913 | 0,01 | | | | | | | | |
| Voya Euro CLO DAC | | | | | | | | | | | |
| 4,715 % éch. 15/10/2030 | 8 475 | 9 276 | 0,01 | | | | | | | | |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust | | | | | | | | | | | |
| 5,600 % éch. 25/07/2047 | \$ 5 710 | 3 373 | 0,01 | | | | | | | | |
| 5,620 % éch. 25/01/2037 | 19 588 | 16 439 | 0,02 | | | | | | | | |
| 5,640 % éch. 25/05/2037 | 3 294 | 2 826 | 0,00 | | | | | | | | |
| 5,640 % éch. 25/07/2047 | 563 | 406 | 0,00 | | | | | | | | |
| 5,660 % éch. 25/04/2037 | 24 600 | 9 271 | 0,01 | | | | | | | | |
| 5,695 % éch. 25/05/2037 | 738 | 684 | 0,00 | | | | | | | | |
| 5,720 % éch. 25/05/2037 | 3 157 | 2 722 | 0,00 | | | | | | | | |
| 5,720 % éch. 25/07/2047 | 5 479 | 3 243 | 0,01 | | | | | | | | |
| 5,830 % éch. 25/04/2037 | 778 | 295 | 0,00 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|----------------------|--|--|---------------------|
| CEW | 4,960 % | 27/12/2023 | 03/01/2024 | CAD 350 000 | Province de l'Ontario 3,750 % éch. 02/12/2053 | \$ (147 735) | \$ 265 433 | \$ 265 766 | 0,38 |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 9 035 | Province du Québec 2,850 % éch. 01/12/2053 Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | (123 985) (9 216) | 9 035 | 9 037 | 0,01 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (280 936) | \$ 274 468 | \$ 274 803 | 0,39 |

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 4 315 | \$ (16 803) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2025 | 1 188 | 4 418 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2026 | 1 289 | 2 933 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2024 | 1 498 | 7 892 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2025 | 1 206 | 3 143 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2024 | 1 990 | 12 145 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2025 | 1 087 | 3 348 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2026 | 1 206 | 2 686 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2024 | 1 390 | 6 192 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2025 | 986 | 2 314 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 230 | (538) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 3 713 | (16 945) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 793 | 1 699 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 3 439 | 8 893 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 21 820 | 77 777 | 0,11 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 723 | 4 050 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 6 124 | (57 375) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 6 106 | (72 131) | (0,10) |
| | | | | \$ (26 302) | (0,04) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (26 302) | (0,04) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Airbus Finance BV | 1,000 % | 20/06/2028 | € 13 400 | \$ 56 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2024 | \$ 69 900 | 216 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/12/2025 | 9 500 | (44) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 9 400 | (63) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 29 400 | 478 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2024 | 5 570 | 176 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/06/2025 | 11 800 | 283 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2025 | 11 700 | 336 | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20/12/2024 | 12 100 | (632) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20/06/2026 | 3 300 | (71) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20/12/2026 | 4 400 | (96) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20/06/2027 | 3 300 | 46 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2024 | 18 900 | (320) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/12/2024 | 44 900 | (747) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2025 | 24 800 | (437) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/12/2025 | 25 300 | 897 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2026 | 8 200 | (147) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/12/2026 | 6 600 | (51) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2027 | 11 500 | 84 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2024 | 7 600 | 195 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 53 500 | 424 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 6 700 | 47 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/06/2025 | € 10 000 | 785 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2025 | 25 100 | 2 815 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/06/2026 | 41 400 | 3 680 | 0,01 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2026 | 114 700 | 6 736 | 0,01 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/06/2027 | 18 100 | 1 733 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | \$ 155 600 | 389 | 0,00 |

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 6 700 | \$ (81) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 32 300 | (369) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 36 150 | 505 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 7 100 | 103 | 0,00 |
| | | | | \$ 16 926 | 0,02 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-35 Index à 5 ans | (1,000) % | 20/12/2025 | \$ 107 200 | \$ 1 013 | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-31 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 99 588 | \$ 3 961 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-32 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2024 | 71 910 | 3 553 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-34 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2025 | 218 224 | 7 427 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-35 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2026 | 1 380 | 40 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-36 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2026 | 525 872 | 36 891 | 0,05 |
| Indice CDX.EM-37 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2027 | 6 958 | 477 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-38 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2027 | 62 500 | 4 320 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-39 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2028 | 31 300 | 1 514 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 311 100 | 6 559 | 0,01 |
| Indice CDX.HY-34 Index à 5 ans | 5,000 | 20/06/2025 | 4 984 | (209) | 0,00 |
| Indice CDX.HY-35 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2025 | 8 245 | (237) | 0,00 |
| Indice CDX.HY-36 Index à 5 ans | 5,000 | 20/06/2026 | 413 317 | 14 081 | 0,02 |
| Indice CDX.HY-37 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2026 | 148 119 | 2 532 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-38 Index à 5 ans | 5,000 | 20/06/2027 | 26 869 | 1 993 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-39 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2027 | 28 126 | 966 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-40 Index à 5 ans | 5,000 | 20/06/2028 | 19 701 | 1 246 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | 3 120 975 | 160 630 | 0,23 |
| Indice CDX.IG-37 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2026 | 1 400 | (6) | 0,00 |
| Indice CDX.IG-38 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2027 | 400 | 4 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-39 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2027 | 200 | 1 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2028 | 1 300 | 8 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 1 658 600 | 9 687 | 0,01 |
| | | | | \$ 255 438 | 0,36 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 0,500 % | 16/09/2030 | £ 254 700 | \$ (6 731) | (0,01) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,060 | 21/02/2052 | 14 400 | (8 064) | (0,01) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,096 | 14/02/2052 | 31 300 | (17 288) | (0,02) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,101 | 21/02/2052 | 14 400 | (7 922) | (0,01) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,175 | 28/02/2052 | 28 800 | (15 294) | (0,02) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 | 20/10/2033 | 20 700 | 2 308 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 876 500 | (88 839) | (0,13) |
| À payer ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 1 488 000 | 698 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 20/09/2026 | ¥ 48 830 000 | (3 235) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/03/2029 | 344 670 000 | 12 946 | 0,02 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,020 | 20/09/2028 | 395 820 000 | 51 710 | 0,07 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,176 | 27/04/2027 | 22 270 000 | (422) | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/06/2032 | 31 750 700 | 3 128 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 15/03/2042 | 15 498 000 | 4 986 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,711 | 27/04/2042 | 5 408 000 | 1 870 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2026 | \$ 1 090 500 | (62 923) | (0,09) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2028 | 2 503 737 | (205 176) | (0,29) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,550 | 15/01/2031 | 4 567 800 | 937 074 | 1,33 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,674 | 05/08/2030 | 62 900 | 12 158 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,678 | 29/07/2030 | 65 200 | 12 595 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,711 | 28/07/2030 | 69 000 | 13 193 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,715 | 27/07/2030 | 200 000 | 38 285 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 30/03/2031 | 963 600 | 176 905 | 0,25 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 16/06/2031 | 3 358 883 | (341 865) | (0,49) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,800 | 15/01/2051 | 1 479 300 | 748 315 | 1,06 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,928 | 06/05/2026 | 150 100 | 12 299 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,975 | 17/06/2052 | 52 200 | 19 186 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,990 | 24/06/2052 | 75 000 | 27 214 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 26/01/2024 | 154 700 | (1 342) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2027 | 386 590 | 29 742 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2029 | 495 770 | 48 594 | 0,07 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2030 | 120 615 | 19 985 | 0,03 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,035 % | 28/06/2052 | \$ 25 900 | \$ 9 106 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,144 | 04/11/2050 | 49 600 | (20 801) | (0,03) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,150 | 30/03/2051 | 191 500 | 5 835 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,215 | 13/10/2050 | 83 500 | (35 074) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,235 | 12/05/2028 | 75 400 | 8 492 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/12/2026 | 1 654 500 | (152 064) | (0,22) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/06/2032 | 15 560 | 2 232 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/06/2032 | 635 270 | (61 879) | (0,09) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/06/2051 | 1 456 600 | 337 622 | 0,48 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,280 | 24/03/2028 | 423 400 | (40 647) | (0,06) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,306 | 02/11/2051 | 48 000 | 16 537 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,317 | 16/12/2050 | 33 800 | (13 120) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,350 | 20/01/2027 | 109 100 | 8 952 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360 | 15/02/2027 | 387 430 | 30 934 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360 | 20/07/2031 | 91 400 | 15 025 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,370 | 19/07/2031 | 61 300 | 10 037 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,380 | 04/01/2027 | 212 800 | (17 028) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,405 | 07/09/2031 | 154 300 | 24 763 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,418 | 20/01/2027 | 71 900 | (5 623) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,420 | 24/02/2027 | 269 100 | 20 797 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,425 | 18/01/2027 | 146 000 | (11 262) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,443 | 18/01/2027 | 157 300 | (12 051) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450 | 17/02/2027 | 361 600 | 27 764 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450 | 16/07/2031 | 137 000 | 21 980 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,485 | 13/01/2051 | 78 100 | (29 089) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 473 684 | (59 621) | (0,08) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 12/01/2029 | 85 443 | 9 467 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 05/10/2031 | 89 100 | (13 779) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,518 | 20/01/2029 | 43 100 | (4 622) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,535 | 15/10/2031 | 88 600 | (13 462) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,535 | 22/10/2031 | 59 100 | (8 921) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,545 | 26/10/2031 | 58 900 | (8 843) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,550 | 20/01/2027 | 485 100 | (34 929) | (0,05) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,570 | 11/01/2027 | 121 400 | (8 888) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,570 | 12/01/2027 | 76 200 | (5 580) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,573 | 28/02/2027 | 96 300 | (8 969) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,580 | 16/02/2027 | 150 400 | (10 500) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,595 | 13/01/2051 | 82 600 | (29 048) | (0,04) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,600 | 16/01/2026 | 943 900 | 31 553 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,600 | 15/02/2027 | 1 549 700 | (106 180) | (0,15) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,618 | 09/02/2029 | 27 100 | (3 211) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,620 | 18/04/2027 | 153 700 | (13 441) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 20/01/2029 | 60 000 | (6 096) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 26/01/2029 | 72 000 | (7 253) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,650 | 24/02/2027 | 897 000 | (59 317) | (0,08) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,650 | 08/02/2032 | 91 900 | (14 329) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,655 | 24/01/2032 | 72 000 | (10 482) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 06/03/2024 | 344 400 | (1 672) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 17/02/2027 | 1 446 200 | (93 731) | (0,13) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 12/01/2029 | 310 700 | (30 113) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,730 | 24/02/2032 | 86 300 | (12 845) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,735 | 12/01/2032 | 57 800 | (8 126) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2029 | 190 144 | 9 438 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 209 290 | 11 637 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 96 400 | (7 798) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,765 | 16/03/2032 | 30 400 | (4 382) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,770 | 14/02/2032 | 81 500 | (11 930) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,783 | 22/04/2027 | 114 300 | (9 211) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,785 | 12/08/2051 | 76 100 | 25 811 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,788 | 03/05/2027 | 114 800 | (9 177) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,815 | 24/01/2052 | 14 400 | (4 543) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,817 | 05/04/2032 | 318 600 | (44 207) | (0,06) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,867 | 26/01/2052 | 14 400 | (4 392) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,872 | 06/04/2032 | 160 000 | (21 467) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,928 | 25/03/2027 | 159 500 | (12 453) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,945 | 23/06/2051 | 127 800 | 38 797 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,988 | 09/02/2032 | 22 000 | 2 586 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2027 | 193 480 | (2 353) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2029 | 910 590 | (9 116) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 18/02/2032 | 133 700 | (15 287) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2032 | 1 477 810 | (4 515) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/12/2051 | 324 000 | 14 044 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,008 | 09/02/2032 | 36 700 | 4 302 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,185 | 21/04/2029 | 96 000 | (8 013) | (0,01) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,300 | 17/01/2026 | 678 900 | 22 155 | 0,03 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,350 | 17/01/2025 | 1 204 900 | 27 206 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,370 | 21/06/2027 | 159 400 | (8 651) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,385 | 08/06/2032 | 26 800 | 2 276 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,430 | 30/09/2027 | 230 020 | 11 426 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 20/12/2024 | 2 408 100 | 56 184 | 0,08 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 04/10/2027 | 221 690 | 10 768 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,451 | 08/06/2032 | 90 600 | 7 325 | 0,01 |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,468 % | 27/07/2028 | \$ 79 800 | \$ (2 755) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,537 | 24/07/2053 | 20 300 | (1 719) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,550 | 21/07/2053 | 20 300 | (1 688) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,605 | 28/06/2027 | 158 600 | (6 995) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,675 | 24/07/2028 | 81 100 | (2 090) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,680 | 11/07/2032 | 27 300 | (1 551) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,690 | 11/07/2032 | 27 300 | (1 525) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,700 | 21/07/2028 | 79 700 | (1 971) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,765 | 27/07/2024 | 377 400 | (7 176) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 77 400 | (1 127) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,850 | 30/08/2027 | 137 400 | (4 252) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,880 | 30/09/2027 | 657 200 | (16 659) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,900 | 04/10/2027 | 633 400 | (15 537) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 78 600 | (1 067) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 96 700 | (1 448) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,955 | 04/10/2027 | 141 800 | (3 226) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 77 700 | (1 043) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | 82 900 | (1 149) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2030 | 2 179 420 | 57 883 | 0,08 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 710 885 | 24 844 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 77 900 | (1 047) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 21/07/2024 | 377 000 | (6 206) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 07/09/2027 | 69 900 | (1 595) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 08/09/2029 | 69 900 | (1 706) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 06/09/2032 | 104 600 | (3 159) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,052 | 24/07/2024 | 376 700 | (6 102) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,080 | 23/02/2053 | 29 400 | (1 603) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 77 800 | (894) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100 | 09/09/2029 | 70 000 | (1 506) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 77 500 | (903) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 77 500 | (871) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 77 500 | (845) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 2 045 860 | 49 091 | 0,07 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 06/03/2033 | 54 100 | (1 397) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,340 | 23/02/2030 | 86 000 | (1 824) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,350 | 14/12/2032 | 28 200 | 398 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 01/03/2033 | 52 300 | (990) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 12/07/2053 | 40 100 | 260 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400 | 23/02/2033 | 49 800 | (829) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,405 | 01/03/2033 | 53 700 | (860) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,420 | 24/05/2033 | 88 200 | (1 017) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,425 | 01/03/2033 | 53 900 | (794) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430 | 27/02/2033 | 53 600 | (762) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450 | 07/03/2033 | 109 100 | (1 381) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 102 500 | (1 324) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 21/06/2026 | 195 110 | 3 168 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/06/2030 | 175 800 | (960) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 4 138 645 | (51 623) | (0,07) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/05/2033 | 5 163 180 | (4 422) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 21/06/2033 | 117 200 | (326) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 290 730 | 8 838 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 37 900 | (374) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,610 | 12/12/2032 | 56 700 | (308) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 155 600 | (1 423) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 158 300 | (1 427) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 10/07/2033 | 60 400 | 576 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 26 000 | (362) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700 | 06/06/2033 | 3 050 720 | (2 843) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730 | 03/08/2033 | 30 800 | 553 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735 | 07/08/2033 | 33 100 | 626 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 155 600 | (1 255) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 159 200 | (1 238) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 13/12/2027 | 141 600 | (260) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 1 360 714 | (19 425) | (0,03) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 1 477 600 | (593) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 12/07/2033 | 57 200 | 1 057 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 26 000 | (511) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,760 | 23/08/2033 | 97 900 | 2 133 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 104 800 | (180) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 24 500 | 393 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 30/08/2033 | 49 300 | 1 253 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 26 000 | (642) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 15 600 | 1 536 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 26 000 | (700) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 52 000 | (1 460) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870 | 17/10/2053 | 15 700 | 1 661 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880 | 16/10/2053 | 15 700 | 1 690 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 30/08/2033 | 49 400 | 1 664 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 13/09/2033 | 146 600 | 5 669 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 51 500 | (1 841) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 103 700 | 4 811 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 51 700 | (2 178) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,040 % | 20/06/2024 | \$ 364 200 | \$ (2 825) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060 | 20/06/2024 | 1 457 000 | (11 009) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,140 | 22/06/2024 | 607 100 | (4 077) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 49 900 | 2 866 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165 | 27/09/2033 | 115 400 | 6 707 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 81 600 | 4 783 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 50 000 | 2 955 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200 | 18/10/2033 | 39 900 | 2 449 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 50 300 | 3 180 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 | 23/10/2033 | 25 100 | 1 614 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2029 | 208 940 | (1 080) | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2031 | 239 020 | (1 564) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 51 700 | (3 068) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255 | 23/10/2033 | 25 100 | 1 668 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393 | 25/10/2033 | 23 500 | 1 834 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 26 400 | 2 181 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 29 800 | 2 485 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 51 700 | 4 343 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 22/05/2025 | 11 396 340 | (23 425) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,900 | 06/06/2025 | 6 663 690 | 13 983 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,100 | 22/05/2024 | 22 102 670 | (23 332) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,400 | 06/06/2024 | 12 921 420 | 13 805 | 0,02 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,874 | 02/01/2026 | BRL 453 700 | (365) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,899 | 02/01/2026 | 229 400 | (163) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,939 | 02/01/2026 | 366 700 | (189) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,998 | 04/01/2027 | 669 600 | (31) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,037 | 04/01/2027 | 163 900 | 27 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,041 | 04/01/2027 | 696 800 | 90 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,052 | 02/01/2026 | 857 800 | (125) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,085 | 02/01/2026 | 851 400 | (36) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,090 | 04/01/2027 | 1 313 900 | 436 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,105 | 02/01/2026 | 843 500 | (9) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,138 | 04/01/2027 | 326 900 | 179 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,157 | 02/01/2025 | 26 500 | (109) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,177 | 02/01/2025 | 17 600 | (71) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,250 | 04/01/2027 | 32 000 | 64 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,275 | 04/01/2027 | 16 100 | 35 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,290 | 04/01/2027 | 16 200 | 37 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,367 | 02/01/2025 | 21 800 | (68) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,731 | 04/01/2027 | 8 300 | 43 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,746 | 04/01/2027 | 35 900 | 191 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,901 | 04/01/2027 | 85 800 | 545 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,018 | 02/01/2025 | 59 500 | (2) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,098 | 02/01/2025 | 98 900 | 33 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,158 | 02/01/2025 | 49 800 | 31 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,163 | 02/01/2025 | 48 800 | 31 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,178 | 02/01/2025 | 99 600 | 71 | 0,00 |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,000 | 16/06/2047 | CAD 2 600 | 625 | 0,00 |
| À recevoir | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 1,300 | 16/06/2047 | 2 500 | 571 | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 3,400 | 20/06/2029 | 6 300 | (576) | 0,00 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | 1 042 300 | 15 716 | 0,02 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,360 | 07/08/2028 | ZAR 550 900 | 481 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,380 | 04/08/2028 | 275 800 | 254 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,400 | 07/08/2028 | 550 900 | 529 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 31/07/2028 | 252 300 | 250 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 04/08/2028 | 664 400 | 655 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 07/08/2028 | 162 900 | 160 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,415 | 31/07/2028 | 201 400 | 202 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,415 | 04/08/2028 | 275 800 | 275 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,420 | 31/07/2028 | 753 500 | 763 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,421 | 04/08/2028 | 281 900 | 285 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,426 | 01/08/2028 | 304 400 | 311 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,428 | 31/07/2028 | 501 600 | 516 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,460 | 01/08/2028 | 513 900 | 563 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,460 | 02/08/2028 | 520 900 | 571 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,464 | 02/08/2028 | 522 200 | 577 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,543 | 04/08/2028 | 280 700 | 358 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,550 | 03/08/2028 | 554 000 | 716 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 2,750 | 17/06/2026 | AUD 72 880 | (1 217) | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 3,000 | 21/03/2027 | 1 179 040 | (42 514) | (0,06) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 3,250 | 17/12/2024 | 197 200 | (7 414) | (0,01) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 3,500 | 17/06/2025 | 361 600 | (18 501) | (0,03) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 17/12/2024 | 97 200 | (8 276) | (0,01) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 18/06/2024 | 124 400 | (13 180) | (0,02) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,150 | 18/03/2030 | e 907 700 | (20 954) | (0,03) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,150 | 17/06/2030 | 244 000 | (8 980) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,294 | 30/06/2026 | 6 200 | 496 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,329 | 30/12/2025 | 13 200 | 888 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,363 | 30/06/2025 | 20 500 | 1 179 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,395 | 30/12/2024 | 10 800 | 453 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,425 | 28/06/2024 | 24 600 | 651 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,500 | 17/06/2050 | 126 900 | 55 316 | 0,08 |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 % | 12/04/2027 | € 331 900 | \$ (21 452) | (0,03) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 113 000 | (7 148) | (0,01) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,830 | 09/12/2052 | 1 064 900 | 62 014 | 0,09 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 243 100 | (12 070) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 116 300 | (5 707) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,750 | 21/09/2027 | 355 500 | (12 248) | (0,02) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,000 | 17/09/2024 | 149 000 | 21 306 | 0,03 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,000 | 21/09/2032 | 170 580 | (12 647) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | 197 900 | 509 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 407 800 | 1 153 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 183 200 | 549 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 26/04/2024 | 200 100 | 1 099 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 184 600 | 853 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 184 500 | 849 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | 127 800 | 4 862 | 0,01 |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 300 | 34 | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 40 900 | (610) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 58 400 | (1 185) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 46 700 | (1 589) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 29 300 | (1 076) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 70 700 | (1 544) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 35 200 | (866) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,970 | 15/12/2033 | 47 100 | (1 951) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 41 100 | (1 772) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 29 400 | (1 476) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,128 | 04/12/2033 | 23 500 | (1 312) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 37 500 | (2 144) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 29 400 | (997) | 0,00 |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 439 600 | (269) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 06/11/2033 | 38 300 | (2 530) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 29 400 | (1 104) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 08/11/2028 | 62 400 | (2 331) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 21/08/2033 | 35 300 | 2 640 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 17 800 | (1 246) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 105 000 | 8 207 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 36 600 | (2 653) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 62 900 | 2 873 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,450 | 20/10/2028 | 61 700 | 3 069 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,165 | 06/09/2032 | MXN 266 600 | (1 282) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,360 | 21/08/2037 | 285 500 | (1 047) | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 7,380 | 14/08/2037 | 111 200 | 164 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,480 | 18/06/2037 | 337 300 | (1 656) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,495 | 14/01/2032 | 2 373 500 | (7 852) | (0,01) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,498 | 15/01/2032 | 5 192 600 | (17 104) | (0,02) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,498 | 19/06/2037 | 810 000 | (3 930) | (0,01) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,103 | 04/01/2038 | 3 750 800 | 4 149 | 0,01 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,280 | 28/11/2036 | 690 000 | (4 279) | (0,01) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,300 | 16/06/2028 | 665 100 | (221) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,310 | 28/11/2036 | 1 066 400 | (6 745) | (0,01) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,410 | 31/03/2027 | 1 182 800 | 1 240 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,444 | 25/07/2028 | 1 502 400 | (688) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,471 | 26/07/2028 | 757 500 | (296) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,512 | 24/07/2028 | 1 136 300 | (354) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,550 | 27/07/2028 | 383 300 | (80) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,556 | 27/07/2028 | 2 280 700 | (443) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,600 | 31/07/2028 | 610 800 | (42) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,620 | 28/07/2028 | 361 800 | (16) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,636 | 28/07/2028 | 722 200 | (6) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,640 | 28/07/2028 | 144 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,650 | 28/07/2028 | 365 300 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,660 | 04/04/2024 | 2 723 700 | 1 409 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,660 | 28/07/2028 | 361 100 | 16 | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,675 | 03/04/2024 | 9 876 200 | 5 089 | 0,01 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,701 | 31/03/2032 | 905 900 | (770) | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,730 | 06/04/2027 | 787 600 | 369 | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,732 | 30/03/2032 | 394 000 | (376) | 0,00 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,750 | 05/04/2024 | 1 956 500 | 978 | 0,00 |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,000 | 15/09/2031 | £ 53 800 | (8 082) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,020 | 15/10/2031 | 69 900 | (9 977) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,055 | 15/09/2031 | 49 800 | (7 339) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,066 | 15/09/2031 | 96 800 | (12 525) | (0,02) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,140 | 15/10/2031 | 135 400 | (17 102) | (0,02) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,250 | 15/11/2031 | 135 600 | (13 360) | (0,02) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,400 | 15/10/2031 | 60 700 | (6 089) | (0,01) |
| | | | | | \$ 912 928 | 1,30 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 1 186 305 | 1,68 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable | Taux | Date | Montant | Coût | Juste | En % de |
|--------------|---|-------------------------|--------------------|---------|------------|---------|------------|------------|---------|
| | | | à payer/à recevoir | | | | | | |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,243 % | 05/08/2024 | 291 100 | \$ 3 930 | \$ 564 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,243 | 05/08/2024 | 291 100 | 3 930 | 7 138 | 0,01 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,110 | 26/07/2032 | 59 200 | 9 590 | 5 940 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,110 | 26/07/2032 | 85 900 | 13 916 | 19 128 | 0,03 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,620 | 22/07/2024 | 869 400 | 6 520 | 765 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,620 | 22/07/2024 | 869 400 | 6 520 | 10 931 | 0,01 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,590 | 19/07/2024 | 616 200 | 8 473 | 1 606 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,590 | 19/07/2024 | 616 200 | 8 473 | 11 910 | 0,02 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,170 | 19/07/2032 | 68 100 | 10 801 | 6 977 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,170 | 19/07/2032 | 76 800 | 12 180 | 16 615 | 0,02 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,400 | 20/07/2027 | 68 100 | 8 986 | 4 442 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,400 | 20/07/2027 | 76 800 | 10 134 | 14 701 | 0,02 |
| | | | | | | | \$ 103 453 | \$ 100 717 | 0,14 |

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable | Taux | Date | Montant | Prime | Juste | En % de |
|--------------|---|-------------------------|--------------------|---------|------------|---------|---------|---------|---------|
| | | | à payer/à recevoir | | | | | | |
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 15 900 | \$ (66) | \$ (63) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 15 900 | (66) | (32) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 26 500 | (122) | (197) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 54 100 | (243) | (679) | 0,00 |
| CBK | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 26 500 | (122) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 54 100 | (243) | (14) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,690 | 02/04/2024 | 41 500 | (326) | (11) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,690 | 02/04/2024 | 41 500 | (326) | (664) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 53 200 | (218) | (169) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 53 200 | (218) | (155) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 22 900 | (90) | (68) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 35 700 | (132) | (403) | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 22 900 | (90) | (68) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 35 700 | (132) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 249 100 | (1 954) | (68) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 249 100 | (1 954) | (3 972) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 | 08/04/2024 | 80 600 | (608) | (25) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 80 600 | (608) | (1 247) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 53 000 | (215) | (151) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 26 700 | (111) | (104) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 51 700 | (220) | (174) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 53 500 | (274) | (564) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 53 500 | (267) | (683) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 52 100 | (237) | (843) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 53 000 | (215) | (171) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 26 700 | (111) | (55) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 51 700 | (220) | (72) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 53 500 | (274) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 59 100 | (135) | (206) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 59 100 | (135) | (2) | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 26 100 | (113) | (82) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 26 500 | (109) | (71) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 18/01/2024 | 26 700 | (132) | (139) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 25 500 | (117) | (402) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 26 100 | (113) | (133) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 26 500 | (109) | (90) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 18/01/2024 | 26 700 | (132) | (46) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 25 500 | (117) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 35 600 | (141) | (275) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 46 900 | (170) | (740) | 0,00 |
| MYC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 35 600 | (141) | (22) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 46 900 | (170) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 53 200 | (258) | (301) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 26 500 | (125) | (173) | 0,00 |

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------------|--------------|---------------------|
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 % | 12/01/2024 | 25 500 | \$ (117) | \$ (402) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 52 900 | (249) | (949) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 53 200 | (258) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 26 500 | (125) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 25 500 | (117) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 52 900 | (249) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 35 500 | (150) | (93) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 35 500 | (150) | (64) | 0,00 |
| UAG | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 26 700 | (130) | (135) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 26 700 | (130) | (48) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (13 821) | \$ (15 040) | (0,02) |

OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉES

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------------|--------------|---------------------|
| FAR | Option d'achat - Taux d'intérêt plafond à 2 ans hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 2 ans | 0,022 % | 08/08/2026 | 291 100 | \$ (5 021) | \$ (8 079) | (0,01) |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 2 ans | 0,022 | 08/08/2026 | 291 100 | (5 021) | (1 554) | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Taux d'intérêt plafond à 1 an hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 1 an | 0,026 | 23/07/2025 | 869 400 | (7 615) | (11 830) | (0,02) |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 1 an | 0,026 | 23/07/2025 | 869 400 | (7 615) | (1 751) | 0,00 |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote | LIBOR USD à 1 an | 0,030 | 24/07/2024 | 1 738 800 | (6 941) | (70) | 0,00 |
| | Option d'achat - Taux d'intérêt plafond à 2 ans hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 2 ans | 0,026 | 23/07/2026 | 616 200 | (10 898) | (14 505) | (0,02) |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 2 ans | 0,026 | 23/07/2026 | 616 200 | (10 897) | (4 104) | (0,01) |
| | | | | | | \$ (54 008) | \$ (41 893) | (0,06) |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|------------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | \$ 97,891 | 09/01/2024 | 57 000 | \$ (223) | \$ (645) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 101,094 | 06/02/2024 | 44 500 | (177) | (360) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 99,227 | 06/02/2024 | 28 500 | (156) | (18) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 101,227 | 06/02/2024 | 28 500 | (107) | (206) | 0,00 |
| MSC | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | 98,406 | 09/01/2024 | 29 500 | (134) | (210) | 0,00 |
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 95,813 | 06/02/2024 | 56 500 | (311) | (252) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 97,813 | 06/02/2024 | 56 500 | (293) | (307) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | 98,469 | 09/01/2024 | 47 500 | (219) | (316) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | 99,906 | 09/01/2024 | 27 000 | (70) | (19) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2054 | 96,813 | 06/02/2024 | 45 500 | (121) | (86) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2054 | 100,813 | 06/02/2024 | 45 500 | (76) | (81) | 0,00 |
| | | | | | \$ (1 887) | \$ (2 500) | 0,00 |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

⁽²⁾ Cet instrument sous-jacent a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | HSBC Holdings PLC | (1,000) % | 20/06/2024 | € 1 300 | \$ 22 | \$ (28) | \$ (6) | 0,00 |
| | UBS AG | (1,000) | 20/06/2024 | \$ 19 300 | 1 254 | (1 312) | (58) | 0,00 |
| BPS | UBS AG | (1,000) | 20/06/2024 | 7 000 | 458 | (479) | (21) | 0,00 |
| | | | | | \$ 1 734 | \$ (1 819) | \$ (85) | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 % | 20/12/2026 | \$ 5 500 | \$ (241) | \$ 206 | \$ (35) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 10 800 | (998) | 1 039 | 41 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 23 000 | (2 501) | 2 600 | 99 | 0,00 |
| BPS | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 14 700 | (705) | 715 | 10 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 2 900 | (259) | 244 | (15) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 4 000 | (287) | 304 | 17 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2025 | 1 300 | (223) | 220 | (3) | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 7 070 | (658) | 685 | 27 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 84 600 | (11 485) | 11 848 | 363 | 0,00 |
| BYL | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 15 260 | (1 322) | 1 388 | 66 | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2024 | 168 400 | (2 908) | 4 129 | 1 221 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2024 | 10 000 | (102) | 146 | 44 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2024 | 29 600 | 116 | 118 | 234 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2026 | 42 900 | (1 989) | 2 280 | 291 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 10 600 | (381) | 388 | 7 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 52 400 | (847) | 1 086 | 239 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2026 | 31 000 | (203) | 679 | 476 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 12 600 | (1 154) | 1 202 | 48 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|---|---|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 % | 20/12/2024 | 4 700 | \$ (490) | \$ 510 | \$ 20 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2024 | 176 800 | (2 751) | 4 034 | 1 283 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 17 600 | (687) | 699 | 12 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien Equinix, Inc. | 1,000 | 20/12/2027 | 8 200 | (731) | 688 | (43) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement indonésien | 5,000 | 20/06/2027 | 9 000 | 1 258 | (196) | 1 062 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2028 | 20 200 | 0 | 273 | 273 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 60 300 | (502) | 1 013 | 511 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2027 | 2 400 | (101) | 132 | 31 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2028 | 9 800 | (103) | 158 | 55 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2025 | 10 200 | (565) | 605 | 40 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 4 800 | (215) | 185 | (30) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 37 500 | (3 786) | 3 929 | 143 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 58 600 | (6 583) | 6 835 | 252 | 0,00 |
| | HUS | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2024 | 51 700 | (1 513) | 1 726 | 213 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien | | 1,000 | 20/06/2024 | 32 400 | (93) | 237 | 144 | 0,00 |
| JPM | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2026 | 2 200 | (101) | 116 | 15 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 3 500 | (135) | 137 | 2 | 0,00 |
| MBC | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2026 | 33 200 | (259) | 769 | 510 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 6 200 | (676) | 703 | 27 | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 21 700 | (781) | 796 | 15 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 24 900 | (2 220) | 2 088 | (132) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 47 400 | (418) | 819 | 401 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2025 | 5 300 | (73) | 150 | 77 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2026 | 56 100 | (326) | 1 187 | 861 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2026 | 44 400 | 68 | 648 | 716 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2027 | 40 600 | (137) | 727 | 590 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2028 | 17 300 | (335) | 495 | 160 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2028 | 74 600 | (787) | 1 204 | 417 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 124 200 | (5 441) | 4 658 | (783) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 17 500 | (1 945) | 2 012 | 67 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 4 600 | (518) | 538 | 20 | 0,00 |
| | | | | | \$ (57 093) | \$ 67 152 | \$ 10 059 | 0,01 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽²⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Indice ABX.HE.AA.6-1 Index | 0,320 % | 25/07/2045 | \$ 661 | \$ (228) | \$ 178 | \$ (50) | 0,00 |
| | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25/05/2046 | 30 130 | (7 681) | 6 490 | (1 191) | 0,00 |
| BRC | Indice CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11/05/2063 | 83 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25/05/2046 | 2 370 | (602) | 508 | (94) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16/12/2072 | 100 000 | (1 840) | 1 169 | (671) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11/05/2063 | 570 | (19) | 19 | 0 | 0,00 |
| CBK | Indice PRIMEX.ARM.2-AAA Index | 4,580 | 25/12/2037 | 194 | 8 | (5) | 3 | 0,00 |
| | Indice CDX.HY-33 Index à 5 ans 35-100 % | 5,000 | 20/12/2024 | 57 942 | 9 647 | (6 821) | 2 826 | 0,00 |
| DUB | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 233 645 | (4 705) | 4 686 | (19) | 0,00 |
| FBF | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18/11/2054 | 512 161 | (3 542) | 2 673 | (869) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 162 200 | (1 133) | 503 | (630) | 0,00 |
| GST | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25/05/2046 | 778 | (187) | 156 | (31) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 1 176 350 | (15 149) | 15 051 | (98) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18/11/2054 | 912 039 | 2 357 | (3 905) | (1 548) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16/12/2072 | 86 300 | (1 494) | 915 | (579) | 0,00 |
| JPS | Indice CMBX.NA.AAA.15 Index | 0,500 | 18/11/2064 | 473 700 | (13 688) | 7 075 | (6 613) | (0,01) |
| | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 171 400 | (2 957) | 2 943 | (14) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18/11/2054 | 171 700 | (1 351) | 1 060 | (291) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 45 500 | (336) | 159 | (177) | 0,00 |
| MEI | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 66 700 | (1 419) | 1 413 | (6) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18/11/2054 | 364 800 | (3 092) | 2 473 | (619) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 923 900 | (14 119) | 10 530 | (3 589) | (0,01) |
| | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16/12/2072 | 379 100 | 507 | (3 052) | (2 545) | (0,01) |
| | Indice CMBX.NA.AAA.14 Index | 0,500 | 16/12/2072 | 171 300 | (4 147) | 2 476 | (1 671) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.15 Index | 0,500 | 18/11/2064 | 74 400 | (631) | (408) | (1 039) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11/05/2063 | 50 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 810 495 | (7 907) | 7 840 | (67) | 0,00 |
| SAL | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18/11/2054 | 152 400 | (785) | 526 | (259) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 1 386 500 | (13 794) | 8 409 | (5 385) | (0,01) |
| | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16/12/2072 | 88 800 | 0 | (596) | (596) | 0,00 |
| UAG | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 15 500 | (445) | 444 | (1) | 0,00 |
| | | | | | \$ (88 734) | \$ 62 911 | \$ (25 823) | (0,04) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|--|----------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC | À recevoir | Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | S/O | 5,066 % | \$ 15 400 | 20/03/2024 | \$ 5 | \$ (33) | \$ (28) | 0,00 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 74 751 | \$ 49 517 | \$ 0 | \$ (1 499) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 1 985 385 | 275 453 | 0 | (4 971) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | £ | 96 968 | 123 151 | 0 | (467) | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD | 786 | 479 | 0 | (19) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 8 567 | £ 6 774 | 69 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 6 428 | MXN 109 352 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 38 096 | ZAR 732 351 | 1 897 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 2 794 394 | \$ 385 812 | 0 | (8 880) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR | 969 195 415 | 61 645 | 0 | (1 204) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 29 195 | IDR 451 932 631 | 112 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 117 768 | INR 9 854 502 | 245 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 53 331 055 | \$ 40 994 | 0 | (520) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | BRL | 772 230 | 158 614 | 18 | (378) | 0,00 |
| | 01/2024 | CNH | 4 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 176 386 | 192 278 | 1 | (2 612) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 364 111 | 461 830 | 5 | (2 358) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 6 880 530 | 19 593 | 0 | (289) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 7 139 800 | 49 498 | 0 | (1 178) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 17 144 832 | 13 050 | 0 | (197) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 8 299 | AUD 12 400 | 168 | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 12 000 | BRL 58 938 | 133 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 830 | CAD 5 174 | 94 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 33 121 | € 30 035 | 95 | (31) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 25 271 | £ 19 882 | 75 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 135 | HKD 1 057 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 12 | HUF 4 166 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 32 650 | IDR 505 014 183 | 119 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 010 475 | ¥ 148 247 278 | 41 736 | 0 | 0,06 |
| | 01/2024 | | 178 | KRW 228 954 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 28 227 | MXN 495 000 | 872 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 127 809 | ZAR 2 369 536 | 1 590 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 18 064 770 | \$ 566 155 | 0 | (30 870) | (0,04) |
| | 02/2024 | \$ | 161 272 | BRL 801 455 | 3 450 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 1 856 000 | \$ 257 894 | 1 | (4 256) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR | 9 738 717 | 619 | 0 | (12) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 10 466 903 | 335 909 | 0 | (10 913) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ | 3 054 | CNH 22 103 | 68 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 121 150 | IDR 1 860 716 263 | 0 | (490) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 124 321 | INR 10 398 052 | 210 | (10) | 0,00 |
| | 04/2024 | | 70 860 | BRL 347 640 | 118 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 219 711 705 | \$ 168 179 | 1 | (2 852) | (0,01) |
| BRC | 01/2024 | HKD | 19 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR | 1 042 945 | 68 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 38 575 155 | 29 850 | 59 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 428 | AUD 2 171 | 54 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 033 | CAD 1 378 | 12 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 080 | CHF 942 | 40 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 037 | £ 1 600 | 3 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 595 | MXN 28 268 | 67 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 112 118 | TRY 3 362 941 | 266 | (156) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 28 637 | ZAR 533 323 | 488 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ | 146 580 000 | \$ 987 006 | 0 | (60 797) | (0,09) |
| | 02/2024 | TRY | 5 561 | 184 | 2 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 6 133 | 194 | 0 | (8) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 80 820 | TRY 2 464 183 | 164 | (291) | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD | 67 | 9 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ | 116 369 000 | 825 041 | 0 | (10 171) | (0,02) |
| | 03/2024 | SGD | 83 | 63 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 20 557 | IDR 319 578 330 | 166 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 63 833 | INR 5 314 736 | 0 | (186) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 5 839 | SGD 7 751 | 58 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 130 950 | TRY 4 116 588 | 35 | (1 111) | 0,00 |
| | 04/2024 | ¥ | 26 379 000 | \$ 188 360 | 0 | (1 404) | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ | 131 165 | TRY 4 229 120 | 0 | (1 850) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 226 231 724 | \$ 173 331 | 0 | (2 773) | 0,00 |
| BSH | 01/2024 | \$ | 793 | MXN 14 614 | 66 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL | 112 008 | \$ 23 004 | 0 | (54) | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF | 886 | 1 017 | 0 | (36) | 0,00 |
| | 01/2024 | COP | 20 000 000 | 4 886 | 0 | (247) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | | | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|----|----------|----|----------|--------|
| | 01/2024 | € | 17 076 | \$ | 18 525 | \$ | 0 | \$ | (343) | \$ | (343) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 31 782 | | 40 238 | | 0 | | (279) | | (279) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 1 005 951 | | 2 870 | | 0 | | (37) | | (37) | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR | 442 799 031 | | 28 767 | | 34 | | 0 | | 34 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 3 996 271 | | 226 820 | | 0 | | (8 110) | | (8 110) | (0,01) |
| | 01/2024 | TRY | 336 | | 11 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 6 560 | AUD | 9 721 | | 76 | | (2) | | 74 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 200 000 | BRL | 996 040 | | 5 048 | | 0 | | 5 048 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 1 601 | CAD | 2 166 | | 42 | | 0 | | 42 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 7 482 | € | 6 760 | | 0 | | (13) | | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 7 321 | £ | 5 782 | | 50 | | 0 | | 50 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 779 | HKD | 6 084 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 151 380 | MXN | 2 770 928 | | 11 515 | | 0 | | 11 515 | 0,02 |
| | 01/2024 | | 505 | ZAR | 9 490 | | 13 | | 0 | | 13 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 678 072 | \$ | 35 931 | | 0 | | (1 099) | | (1 099) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 4 228 779 | | 273 | | 0 | | (1) | | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | ILS | 125 | | 34 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 167 562 | | 44 491 | | 0 | | (657) | | (657) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 409 145 | BRL | 2 025 225 | | 5 262 | | 0 | | 5 262 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 28 767 | IDR | 442 912 662 | | 0 | | (46) | | (46) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 5 739 | INR | 479 767 | | 7 | | 0 | | 7 | 0,00 |
| | 04/2024 | ¥ | 10 998 000 | \$ | 78 521 | | 0 | | (596) | | (596) | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ | 23 004 | BRL | 113 142 | | 96 | | 0 | | 96 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 1 464 722 | \$ | 1 132 | | 0 | | (8) | | (8) | 0,00 |
| | 06/2024 | \$ | 87 | KRW | 114 136 | | 1 | | 0 | | 1 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | CAD | 354 335 | \$ | 267 019 | | 0 | | (1 706) | | (1 706) | 0,00 |
| | 01/2024 | CLP | 2 002 766 | | 2 266 | | 0 | | (25) | | (25) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 21 964 930 | | 16 900 | | 0 | | (52) | | (52) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 68 405 | MXN | 1 199 589 | | 2 116 | | 0 | | 2 116 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 20 518 | \$ | 1 077 | | 0 | | (43) | | (43) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 1 663 633 | | 230 874 | | 0 | | (4 104) | | (4 104) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR | 1 204 850 | | 77 | | 0 | | (1) | | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD | 2 461 | | 1 859 | | 0 | | (13) | | (13) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 363 627 | BRL | 1 805 078 | | 5 733 | | 0 | | 5 733 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 8 927 | IDR | 139 445 728 | | 115 | | 0 | | 115 | 0,00 |
| GLM | 06/2024 | KRW | 244 568 282 | \$ | 187 894 | | 0 | | (2 484) | | (2 484) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 3 180 530 | | 2 341 091 | | 0 | | (71 231) | | (71 231) | (0,10) |
| | 01/2024 | CHF | 3 917 | | 4 470 | | 0 | | (187) | | (187) | 0,00 |
| | 01/2024 | HKD | 510 | | 65 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 559 912 | | 32 292 | | 0 | | (624) | | (624) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 268 848 | BRL | 1 350 260 | | 9 121 | | 0 | | 9 121 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 3 488 | £ | 2 738 | | 2 | | 0 | | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 301 474 | MXN | 5 284 472 | | 9 186 | | 0 | | 9 186 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 83 840 | TRY | 2 559 882 | | 932 | | 0 | | 932 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 120 | ZAR | 77 076 | | 89 | | 0 | | 89 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 333 771 | \$ | 17 532 | | 0 | | (691) | | (691) | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL | 5 573 | | 1 150 | | 5 | | 0 | | 5 | 0,00 |
| | 02/2024 | TRY | 2 748 | | 90 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 396 473 | BRL | 2 006 591 | | 15 940 | | 0 | | 15 940 | 0,02 |
| | 02/2024 | | 22 703 | TRY | 692 389 | | 0 | | (186) | | (186) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 864 771 | \$ | 119 854 | | 0 | | (2 290) | | (2 290) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 2 977 291 | | 191 | | 0 | | (2) | | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 118 324 | IDR | 1 820 084 667 | | 0 | | (298) | | (298) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 80 590 | TRY | 2 528 448 | | 0 | | (908) | | (908) | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | BRL | 1 643 926 | \$ | 337 272 | | 0 | | (1 152) | | (1 152) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 27 457 834 | | 78 227 | | 0 | | (1 118) | | (1 118) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 33 100 | IDR | 509 309 700 | | 0 | | (65) | | (65) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 13 077 | KRW | 16 914 827 | | 0 | | (7) | | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 936 | MXN | 16 595 | | 40 | | 0 | | 40 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 34 526 | TRY | 1 033 289 | | 0 | | (35) | | (35) | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 4 741 086 | \$ | 148 016 | | 0 | | (8 673) | | (8 673) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ | 15 640 | TRY | 477 384 | | 0 | | (86) | | (86) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 2 932 250 576 | \$ | 189 140 | | 0 | | (1 005) | | (1 005) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD | 7 660 | | 5 777 | | 0 | | (51) | | (51) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 11 027 800 | | 354 831 | | 0 | | (10 576) | | (10 576) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ | 998 334 | BRL | 4 930 398 | | 10 536 | | 0 | | 10 536 | 0,01 |
| | 03/2024 | | 492 | CNH | 3 497 | | 2 | | 0 | | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 66 034 | IDR | 1 019 503 605 | | 77 | | 0 | | 77 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 122 718 | INR | 10 259 438 | | 144 | | 0 | | 144 | 0,00 |
| | 04/2024 | | 142 978 | BRL | 703 310 | | 617 | | 0 | | 617 | 0,00 |
| MBC | 06/2024 | KRW | 235 545 677 | \$ | 181 754 | | 23 | | (1 623) | | (1 600) | 0,00 |
| | 01/2024 | AUD | 30 412 | | 20 165 | | 0 | | (591) | | (591) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 4 362 649 | | 4 769 886 | | 0 | | (50 421) | | (50 421) | (0,07) |
| | 01/2024 | £ | 16 589 | | 20 923 | | 0 | | (226) | | (226) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 1 617 168 | | 4 595 | | 0 | | (78) | | (78) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 19 180 000 | | 130 258 | | 0 | | (6 280) | | (6 280) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 1 216 | CAD | 1 645 | | 32 | | 0 | | 32 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 3 053 | £ | 2 398 | | 4 | | 0 | | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 1 369 442 | \$ | 71 655 | | 0 | | (3 142) | | (3 142) | (0,01) |
| | 02/2024 | TRY | 93 | | 3 | | 0 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 22 002 | | 3 035 | | 0 | | (73) | | (73) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 80 528 | IDR | 1 241 376 492 | | 0 | | (30) | | (30) | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| MYI | 01/2024 | AUD | 377 | \$ 258 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF | 460 | 544 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 23 067 | 25 619 | 138 | 0 | 138 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 2 946 | 3 762 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 3 101 593 | 8 815 | 0 | (148) | (148) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 8 944 | 63 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD | 19 150 | 14 509 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY | 10 701 | 364 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 5 959 | € 5 394 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 15 906 | £ 12 559 | 117 | (12) | 105 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 546 555 | ¥ 80 574 363 | 25 336 | 0 | 25 336 | 0,03 |
| | 01/2024 | | 22 | NOK 225 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 50 | SGD 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 161 365 | ZAR 3 020 699 | 3 610 | 0 | 3 610 | 0,01 |
| | 01/2024 | ZAR | 469 270 | \$ 24 641 | 0 | (990) | (990) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 364 | TRY 11 032 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 1 894 604 | \$ 262 716 | 0 | (4 886) | (4 886) | (0,01) |
| | 03/2024 | ¥ | 27 972 000 | 192 266 | 0 | (8 202) | (8 202) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 307 707 | IDR 4 738 017 783 | 205 | (669) | (464) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 142 969 767 | \$ 109 922 | 0 | (1 370) | (1 370) | 0,00 |
| RBC | 04/2024 | \$ | 148 376 | MXN 2 624 776 | 3 935 | 0 | 3 935 | 0,01 |
| RYL | 01/2024 | £ | 248 | \$ 312 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | | 1 587 029 | 2 007 398 | 0 | (15 812) | (15 812) | (0,02) |
| | 01/2024 | SEK | 15 620 | 1 504 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 44 101 | ¥ 6 356 300 | 1 014 | 0 | 1 014 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 1 738 202 | \$ 91 635 | 0 | (3 287) | (3 287) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH | 1 860 021 | 256 927 | 0 | (5 790) | (5 790) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR | 488 402 194 | 31 125 | 0 | (546) | (546) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 957 287 | 30 340 | 0 | (1 380) | (1 380) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 500 | HKD 3 898 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 92 164 | IDR 1 431 202 706 | 907 | (263) | 644 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 550 126 | INR 46 020 167 | 988 | 0 | 988 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 116 667 081 | \$ 89 877 | 0 | (940) | (940) | 0,00 |
| SOG | 01/2024 | \$ | 25 254 | BRL 123 097 | 87 | 0 | 87 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 785 | MXN 87 791 | 376 | 0 | 376 | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD | 28 | \$ 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | £ | 13 121 | 16 511 | 0 | (216) | (216) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 107 | HKD 836 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | ¥ | 285 163 | \$ 1 944 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 02/2024 | | 6 905 000 | 46 663 | 0 | (2 553) | (2 553) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 899 552 | 124 592 | 0 | (2 464) | (2 464) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 422 877 945 | 26 789 | 0 | (634) | (634) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | AUD | 24 803 | 16 456 | 0 | (472) | (472) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 339 275 | 428 977 | 0 | (3 545) | (3 545) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ | 15 387 000 | 104 371 | 0 | (5 063) | (5 063) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN | 882 866 | 49 871 | 0 | (2 030) | (2 030) | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY | 388 373 | 13 219 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 0 | HKD 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 57 704 | ¥ 8 453 617 | 2 296 | 0 | 2 296 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 111 697 | ZAR 2 132 174 | 4 739 | 0 | 4 739 | 0,01 |
| | 02/2024 | | 13 219 | TRY 400 535 | 0 | (108) | (108) | 0,00 |
| | | | | | \$ 173 242 | \$ (395 890) | \$ (222 648) | (0,31) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de capitalisation, Institutions en AUD (couverte) de distribution, Investisseurs en AUD (couverte) de distribution, Administrations en AUD (couverte) de distribution, E en AUD (couverte) de distribution et Z en AUD (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| AZD | 01/2024 | \$ | 296 836 | AUD 448 210 | \$ 9 060 | \$ 0 | \$ 9 060 | 0,01 |
| BOA | 01/2024 | | 614 769 | 929 490 | 19 591 | 0 | 19 591 | 0,03 |
| BPS | 01/2024 | AUD | 13 370 | \$ 9 002 | 0 | (123) | (123) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 3 886 | AUD 5 732 | 31 | (5) | 26 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | | 55 890 | 84 733 | 1 938 | 0 | 1 938 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | AUD | 59 | \$ 39 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 3 729 | AUD 5 543 | 55 | (1) | 54 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | | 1 297 | 1 930 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | | 345 290 | 520 738 | 10 105 | 0 | 10 105 | 0,01 |
| RBC | 01/2024 | | 12 670 | 19 169 | 413 | 0 | 413 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | | 780 | 1 160 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | | 439 557 | 662 515 | 12 598 | 0 | 12 598 | 0,02 |
| | | | | | \$ 53 824 | \$ (130) | \$ 53 694 | 0,07 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en BRL (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | BRL 288 289 | \$ 58 775 | \$ 0 | \$ (573) | \$ (573) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 101 110 | BRL 497 543 | 1 316 | 0 | 1 316 | 0,00 |
| | 02/2024 | 58 775 | 289 494 | 725 | 0 | 725 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | BRL 253 927 | \$ 52 050 | 0 | (224) | (224) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 667 | BRL 47 385 | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| | 02/2024 | 52 013 | 254 827 | 361 | 0 | 361 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL 569 872 | \$ 115 383 | 0 | (1 934) | (1 934) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 110 380 | BRL 542 063 | 1 211 | 0 | 1 211 | 0,00 |
| | 02/2024 | 115 144 | 571 053 | 2 225 | 0 | 2 225 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | BRL 8 972 | \$ 1 861 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 13 647 | BRL 67 484 | 245 | 0 | 245 | 0,00 |
| | 02/2024 | 1 854 | 8 972 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | BRL 575 614 | \$ 116 844 | 0 | (1 653) | (1 653) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 111 281 | BRL 542 199 | 338 | 0 | 338 | 0,00 |
| | 02/2024 | 111 157 | 549 584 | 1 804 | (5) | 1 799 | 0,00 |
| | | | | \$ 8 327 | \$ (4 399) | \$ 3 928 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CAD (couverte) de capitalisation et Institutions en CAD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | \$ 125 | CAD 169 | \$ 4 | \$ 0 | \$ 4 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 46 175 | CAD 62 792 | 1 450 | 0 | 1 450 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | CAD 679 | \$ 499 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 2 066 | 1 559 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 51 736 | CAD 70 307 | 1 589 | 0 | 1 589 | 0,01 |
| JPM | 01/2024 | CAD 1 421 | \$ 1 077 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | \$ 7 304 | CAD 9 884 | 193 | 0 | 193 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | CAD 645 | \$ 489 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 899 | CAD 6 460 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 52 096 | 70 665 | 1 501 | 0 | 1 501 | 0,00 |
| | | | | \$ 4 737 | \$ (24) | \$ 4 713 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 351 | \$ 408 | \$ 0 | \$ (10) | \$ (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 626 | CHF 1 392 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 177 390 | 154 665 | 6 469 | 0 | 6 469 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | CHF 1 026 | \$ 1 177 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 159 108 | CHF 138 563 | 5 610 | 0 | 5 610 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | 288 231 | 252 542 | 11 982 | 0 | 11 982 | 0,02 |
| MYI | 01/2024 | 254 045 | 221 758 | 9 572 | 0 | 9 572 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | 1 925 | 1 655 | 46 | (3) | 43 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 2 251 | 1 962 | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| | | | | \$ 33 790 | \$ (56) | \$ 33 734 | 0,05 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution A, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de distribution II, E en EUR (couverte) de distribution II Q, G Détail en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de distribution, T en EUR (couverte) de capitalisation et T en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 14 302 | \$ 15 571 | \$ 28 | \$ (259) | \$ (231) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 757 466 | € 5 231 461 | 22 806 | (10) | 22 796 | 0,03 |
| BRC | 01/2024 | 5 562 108 | 5 057 473 | 25 914 | 0 | 25 914 | 0,04 |
| CBK | 01/2024 | € 124 578 | \$ 137 870 | 233 | (10) | 223 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 96 511 | € 88 280 | 1 030 | 0 | 1 030 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 15 491 | \$ 16 950 | 0 | (166) | (166) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 150 880 | € 4 710 943 | 54 259 | 0 | 54 259 | 0,08 |
| SCX | 01/2024 | 646 141 | 592 017 | 7 981 | 0 | 7 981 | 0,01 |
| | | | | \$ 112 251 | \$ (445) | \$ 111 806 | 0,16 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de distribution, Administrations en GBP (couverte) de distribution, E en GBP (couverte) de distribution et R en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 139 | \$ 176 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 80 032 | £ 63 158 | 485 | 0 | 485 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 49 | \$ 62 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 410 161 | £ 324 591 | 3 645 | (4) | 3 641 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 1 493 | 1 181 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 9 565 | \$ 12 061 | 0 | (133) | (133) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 38 229 | £ 30 201 | 272 | 0 | 272 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 2 592 | 2 035 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 7 190 | \$ 9 154 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 45 061 | £ 35 587 | 307 | 0 | 307 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 439 | \$ 552 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 003 | £ 3 134 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 491 657 | 388 699 | 3 872 | 0 | 3 872 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | 403 | 320 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 491 521 | 388 380 | 3 601 | 0 | 3 601 | 0,01 |
| | | | | \$ 12 201 | \$ (166) | \$ 12 035 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en JPY (couverte) de capitalisation, Investisseurs en JPY (couverte) de capitalisation, E en JPY (couverte) de capitalisation et E en JPY (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 63 719 | ¥ 9 403 005 | \$ 3 020 | \$ 0 | \$ 3 020 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 20 468 | 2 984 854 | 718 | 0 | 718 | (0,01) |
| CBK | 01/2024 | 5 423 | 767 220 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 120 673 | 17 714 671 | 5 060 | 0 | 5 060 | 0,01 |
| MBC | 01/2024 | 2 634 | 378 139 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 81 101 | 11 951 385 | 3 726 | 0 | 3 726 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | 135 980 | 19 978 736 | 5 737 | 0 | 5 737 | 0,01 |
| | 02/2024 | 134 135 | 18 827 389 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | \$ 18 333 | \$ (1) | \$ 18 332 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 58 008 | NOK 616 775 | \$ 2 733 | \$ 0 | \$ 2 733 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 79 908 | 854 976 | 4 292 | 0 | 4 292 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | NOK 895 | \$ 86 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 72 031 | NOK 774 479 | 4 241 | 0 | 4 241 | 0,01 |
| MBC | 01/2024 | 143 | 1 556 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 140 | 1 526 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | NOK 1 427 | \$ 134 | 1 | (7) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 962 | NOK 10 251 | 47 | 0 | 47 | (0,01) |
| SCX | 01/2024 | 5 322 | 57 268 | 318 | 0 | 318 | 0,00 |
| | | | | \$ 11 653 | \$ (9) | \$ 11 644 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en RMB (couverte) de distribution, Investisseurs en RMB (couverte) de capitalisation et E en RMB (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 286 | CNH 2 054 | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 95 287 | 678 301 | 64 | (50) | 14 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CNH 4 651 | \$ 652 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 523 | CNH 10 843 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 46 501 | 331 813 | 118 | 0 | 118 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | 1 049 | 7 507 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | CNH 15 830 | \$ 2 214 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 726 | 242 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 7 245 | CNH 51 645 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | CNH 12 471 | \$ 1 752 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 867 | CNH 13 307 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | \$ 205 | \$ (63) | \$ 142 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation, Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de capitalisation, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, Administrations en SGD (couverte) de distribution et E en SGD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 26 348 | SGD 35 136 | \$ 296 | \$ 0 | \$ 296 | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | 145 157 | 193 659 | 1 695 | 0 | 1 695 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | 1 670 530 | 2 220 652 | 13 403 | 0 | 13 403 | 0,02 |
| GLM | 01/2024 | 107 786 | 144 117 | 1 495 | 0 | 1 495 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | 420 476 | 560 877 | 4 840 | 0 | 4 840 | 0,01 |
| MBC | 01/2024 | SGD 20 101 | \$ 15 052 | 0 | (191) | (191) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 75 423 | SGD 100 664 | 905 | 0 | 905 | 0,00 |
| | 02/2024 | 71 957 | 95 101 | 276 | (30) | 246 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 1 553 612 | 2 072 418 | 17 914 | 0 | 17 914 | 0,03 |
| | 02/2024 | SGD 31 130 | \$ 23 618 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | \$ 1 252 065 | SGD 1 670 582 | 14 747 | 0 | 14 747 | 0,02 |
| UAG | 01/2024 | SGD 23 234 | \$ 17 470 | 0 | (144) | (144) | 0,00 |
| | | | | \$ 55 571 | \$ (381) | \$ 55 190 | 0,08 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 107 977 0,15

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Ginnie Mae, TBA | | | |
| 2,500 % éch. 01/01/2054 | \$ 33 900 | \$ (29 660) | (0,04) |
| 5,500 % éch. 01/01/2054 | 443 200 | (446 456) | (0,63) |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 4,500 % éch. 01/03/2054 | 476 000 | (461 515) | (0,66) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (937 631) | (1,33) |
| Total des Investissements | | \$ 99 359 858 | 140,85 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (28 816 741) | (40,85) |
| Actifs nets | | \$ 70 543 117 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

µ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement. Pour de plus amples informations sur les engagements de prêts non financés, veuillez vous reporter à la Note 4, Titres et autres investissements, des Notes relatives aux États financiers.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre à principal uniquement.
- (c) Titre vendu avant l'émission.
- (d) Titre à rémunération en nature.
- (e) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (f) Titre à coupon zéro.
- (g) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (h) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (i) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (j) Affilié au Fonds.
- (k) Titre convertible conditionnel.
- (l) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,97 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|------------|--------------|---------------------|
| AMSURG Corp. | 02/11/2023 - 06/11/2023 | \$ 146 801 | \$ 180 198 | 0,26 |
| Chester A PLC 0,000 % échéance 17/03/2046 | 18/04/2019 | 12 934 | 16 418 | 0,02 |
| Chester A PLC 0,000 % échéance 20/05/2046 | 18/04/2019 | 17 298 | 5 173 | 0,01 |
| Chester A PLC 6,020 % échéance 17/03/2046 | 18/04/2019 | 54 314 | 53 351 | 0,08 |
| Chester A PLC 6,470 % échéance 17/03/2046 | 18/04/2019 | 19 159 | 18 769 | 0,03 |
| Chester A PLC 6,970 % échéance 17/03/2046 | 18/04/2019 | 17 790 | 17 407 | 0,03 |
| Chester A PLC 7,470 % échéance 17/03/2046 | 18/04/2019 | 10 947 | 10 687 | 0,02 |
| Chester A PLC 8,220 % échéance 17/03/2046 | 18/04/2019 | 5 473 | 5 337 | 0,01 |
| Citigroup, Inc. 2,572 % échéance 03/06/2031 | 07/12/2023 | 4 191 | 4 274 | 0,01 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2021 | 10/06/2022 | 0 | 0 | 0,00 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » | 10/06/2022 | 353 | 353 | 0,00 |
| Corestate Capital Holding S.A. | 22/08/2023 | 0 | 0 | 0,00 |

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|-------------------------|------------|--------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG 2,129 % échéance 24/11/2026 | 11/01/2023 | \$ 22 257 | \$ 22 792 | 0,03 |
| Deutsche Bank AG 3,035 % échéance 28/05/2032 | 25/05/2021 - 29/09/2021 | 46 067 | 38 388 | 0,05 |
| Intelsat Emergence S.A. | 19/06/2017 - 23/02/2022 | 440 150 | 132 746 | 0,19 |
| Morgan Stanley 0,000 % échéance 02/04/2032 | 11/02/2020 | 60 270 | 41 638 | 0,06 |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC | 25/09/2020 | 37 976 | 176 804 | 0,25 |
| Oracle Corp. 4,100 % échéance 25/03/2061 | 25/03/2021 - 05/10/2021 | 14 445 | 10 003 | 0,01 |
| Serta Simmons Bedding LLC | 29/06/2023 | 1 402 | 10 | 0,00 |
| Sierra Hamilton Holder LLC | 31/07/2017 | 560 | 0 | 0,00 |
| Westmoreland Mining Holdings LLC | 08/12/2014 - 19/12/2019 | 1 491 | 205 | 0,00 |
| Westmoreland Mining LLC | 03/07/2023 | 338 | 179 | 0,00 |
| | | \$ 914 216 | \$ 734 732 | 1,06 |

(m) Un titre d'une juste valeur globale de 502 \$ (31 décembre 2022 : 19 079 \$) et un montant en numéraire de 1 172 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 1 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 273 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 514 049 \$ (31 décembre 2022 : 1 599 431 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 76 085 \$ (31 décembre 2022 : 188 008 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|----------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 257 726 | \$ 95 849 535 | \$ 842 568 | \$ 96 949 829 |
| Fonds d'investissement | 1 515 725 | 289 487 | 0 | 1 805 212 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 274 468 | 0 | 274 468 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (17 482) | 1 286 825 | (1 363) | 1 267 980 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (937 631) | 0 | (937 631) |
| Totaux | \$ 1 755 969 | \$ 96 762 684 | \$ 841 205 | \$ 99 359 858 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|----------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 330 063 | \$ 65 894 167 | \$ 1 022 241 | \$ 67 246 471 |
| Fonds d'investissement | 1 793 842 | 287 586 | 0 | 2 081 428 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 3 421 698 | 0 | 3 421 698 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 35 705 | 1 477 546 | 3 | 1 513 254 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (734 103) | 0 | (734 103) |
| Totaux | \$ 2 159 610 | \$ 70 346 894 | \$ 1 022 244 | \$ 73 528 748 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| JML | 2,250 % | 14/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (447) | \$ (495) | 0,00 |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (495) | 0,00 |

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 2 888 | \$ (3 940) | \$ (1 052) | \$ 2 601 | \$ (920) | \$ 1 681 |
| BOA | 17 923 | (17 500) | 423 | (36 145) | 30 410 | (5 735) |
| BOM | S/O | S/O | | (1 847) | 2 130 | 283 |
| BPS | 17 770 | (62 687) | (44 917) | 37 581 | (31 520) | 6 061 |
| BRC | (41 205) | 12 970 | (28 235) | (19 965) | 16 765 | (3 200) |
| BSH | 66 | 0 | 66 | (15) | 0 | (15) |
| BYL | 66 | 0 | 66 | (1 443) | 0 | (1 443) |
| CBK | 27 413 | (31 601) | (4 188) | 63 317 | (64 234) | (917) |
| CLY | S/O | S/O | | 29 | 0 | 29 |
| DUB | 12 926 | (16 750) | (3 824) | (21 446) | 18 530 | (2 916) |
| FAR | (1 931) | 1 840 | (91) | (2 129) | 2 290 | 161 |
| FBF | (1 499) | 1 643 | 144 | (4 557) | 4 715 | 158 |
| GLM | 426 | 13 900 | 14 326 | (618) | (8 230) | (8 848) |
| GST | (5 488) | (92 884) | (98 372) | (18 731) | 8 496 | (10 235) |
| HUS | 357 | (500) | (143) | 1 179 | (520) | 659 |
| JPM | (9 341) | 10 510 | 1 169 | 9 738 | (8 970) | 768 |
| JPS | (305) | 220 | (85) | (1 195) | 1 120 | (75) |
| MBC | 4 940 | (9 640) | (4 700) | 112 677 | (90 850) | 21 827 |
| MEI | (177) | 286 | 109 | (363) | 294 | (69) |
| MSC | (210) | 0 | (210) | S/O | S/O | S/O |
| MYC | 26 609 | 16 040 | 42 649 | (9 537) | (29 220) | (38 757) |
| MYI | 44 314 | (60 260) | (15 946) | 44 132 | (35 730) | 8 402 |
| RBC | 4 348 | (3 900) | 448 | (1 592) | 2 500 | 908 |
| RYL | 49 | 0 | 49 | (10 431) | 8 200 | (2 231) |
| SAL | (7 368) | 7 430 | 62 | (15 988) | 16 088 | 100 |
| SCX | (7 202) | 5 630 | (1 572) | 122 133 | (112 350) | 9 783 |
| SOG | 463 | (420) | 43 | 10 | 0 | 10 |
| SSB | (211) | 180 | (31) | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 9 016 | (8 540) | 476 | 1 135 | (920) | 215 |
| UAG | 13 340 | (12 670) | 670 | (36 981) | 30 720 | (6 261) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 53,15 | 68,71 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 83,76 | 45,07 |
| Autres valeurs mobilières | 0,53 | 2,21 |
| Fonds d'investissement | 2,56 | 3,59 |
| Contrats de mise en pension | 0,39 | 5,90 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,04) | 0,15 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 1,68 | 2,09 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,15 | 0,37 |
| Titres vendus à découvert | (1,33) | (1,27) |
| Contrats de prise en pension | 0,00 | (0,03) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés règlementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 1,83 | 3,66 |
| Obligations et billets privés | 20,33 | 22,63 |
| Obligations et billets convertibles | 0,03 | 0,03 |
| Obligations et billets municipaux | 0,12 | 0,15 |
| Agences du gouvernement américain | 62,99 | 35,26 |
| Obligations du Trésor américain | 21,40 | 17,94 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 10,79 | 12,73 |
| Titres adossés à des actifs | 9,14 | 8,72 |
| Émissions souveraines | 5,49 | 5,29 |
| Actions ordinaires | 0,95 | 0,93 |
| Droits | S/O | 0,01 |
| Bons de souscription | 0,00 | 0,07 |
| Titres privilégiés | 0,20 | 0,23 |
| Sociétés d'investissement immobilier | 0,27 | 0,34 |
| Instruments à court terme | 3,90 | 8,00 |
| Fonds d'investissement | 2,56 | 3,59 |
| Contrats de mise en pension | 0,39 | 5,90 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,04) | 0,16 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,36 | 0,41 |
| Swaps de taux d'intérêt | 1,30 | 1,68 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,14 | 0,21 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (0,17) |
| Options à taux d'intérêt plafonnées | (0,06) | (0,10) |
| Options sur titres | 0,00 | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | (0,06) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | (0,04) | (0,06) |
| Swaps de rendement total sur indices | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,31) | (0,26) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,43 | 0,82 |
| Titres vendus à découvert | (1,33) | (1,27) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (40,85) | (26,82) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund II

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|--------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------|--|----------------------------------|------------------------------|--|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | Wells Fargo & Co. | | | | 7,250 % éch. 17/03/2044 | | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | 5,557 % éch. 25/07/2034 | | | | 42 \$ 44 \$ 0,04 | | | | |
| Air Canada | \$ | 197 | \$ 198 | 0,16 | INDUSTRIE | | | | Vistra Operations Co. LLC | | | |
| CommScope, Inc. | | 197 | 177 | 0,14 | American Airlines Pass-Through Trust | | | | 6,950 % éch. 15/10/2033 | | | |
| Poseidon Bidco SASU | € | 200 | 221 | 0,18 | 3,375 % éch. 01/11/2028 | | | | 800 843 0,67 | | | |
| U.S. Renal Care, Inc. | \$ | 209 | 160 | 0,13 | BAT Capital Corp. | | | | 4 268 3,41 | | | |
| United Airlines, Inc. | | 194 | 194 | 0,15 | 6,343 % éch. 02/08/2030 | | | | Total Obligations et billets privés | | | |
| Worldpay LLC | | 250 | 251 | 0,20 | 6,421 % éch. 02/08/2033 | | | | 23 343 18,65 | | | |
| TBD % éch. 31/01/2031 | | | | | Broadcom, Inc. | | | | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| | | | 1 201 | 0,96 | 2,450 % éch. 15/02/2031 | | | | Ginnie Mae | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Charter Communications Operating LLC | | | | 5,500 % éch. 20/07/2053 | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | 3,500 % éch. 01/06/2041 | | | | 693 698 0,56 | | | | |
| AGFC Capital Trust | | 440 | 224 | 0,18 | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. | | | | Ginnie Mae, TBA | | | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. | | 400 | 355 | 0,28 | 7,750 % éch. 15/04/2028 | | | | 5,000 % éch. 01/01/2054 | | | |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | € | 200 | 210 | 0,17 | Community Health Systems, Inc. | | | | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme | | | |
| 6,750 % éch. 02/03/2026 | | 640 | 724 | 0,58 | 5,625 % éch. 15/03/2027 | | | | (UMBS) | | | |
| Bank of America Corp. | \$ | 500 | 501 | 0,40 | CSC Holdings LLC | | | | 3,000 % éch. 01/06/2052 | | | |
| Bank of Ireland Group PLC | | | | | 4,500 % éch. 15/11/2031 | | | | 3,500 % éch. 01/05/2052 - | | | |
| 6,000 % éch. 01/09/2025 | € | 200 | 218 | 0,17 | Directv Financing LLC | | | | 01/02/2053 | | | |
| (d)(f) | | | | | 5,875 % éch. 15/08/2027 | | | | 4,000 % éch. 01/09/2048 - | | | |
| BNP Paribas S.A. | \$ | 300 | 307 | 0,25 | DISH DBS Corp. | | | | 01/04/2053 | | | |
| 7,750 % éch. 16/08/2029 | | | | | 5,250 % éch. 01/12/2026 | | | | 4,500 % éch. 01/10/2052 - | | | |
| (d)(f) | | | | | 5,750 % éch. 01/12/2028 | | | | 01/08/2053 | | | |
| BPCE S.A. | | 800 | 870 | 0,69 | Enbridge, Inc. | | | | 5,000 % éch. 01/01/2053 | | | |
| 7,003 % éch. 19/10/2034 | | | | | 5,700 % éch. 01/03/2053 | | | | 6,000 % éch. 01/04/2053 | | | |
| CaixaBank S.A. | | 350 | 357 | 0,29 | GTGR W-2 Merger Sub LLC | | | | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme | | | |
| 6,208 % éch. 18/01/2029 | | 350 | 359 | 0,29 | 7,500 % éch. 15/01/2031 | | | | (UMBS), TBA | | | |
| 6,684 % éch. 13/09/2027 | | | | | iHeartCommunications, Inc. | | | | 3,000 % éch. 01/01/2054 | | | |
| Capital One Financial Corp. | | 200 | 220 | 0,18 | 4,750 % éch. 15/01/2028 | | | | 3,500 % éch. 01/02/2054 | | | |
| 7,624 % éch. 30/10/2031 | | | | | IntelSat Jackson Holdings S.A. | | | | 5,000 % éch. 01/02/2054 | | | |
| Citizens Bank N.A. | | 300 | 290 | 0,23 | 6,500 % éch. 15/03/2030 | | | | 5,500 % éch. 01/03/2053 | | | |
| 5,284 % éch. 26/01/2026 | | | | | MGM China Holdings Ltd. | | | | 6,000 % éch. 01/02/2054 | | | |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. | | 200 | 15 | 0,01 | 4,750 % éch. 01/02/2027 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 2,700 % éch. 12/07/2026 ^ | | | | | Mundys SpA | | | | 6,000 % éch. 01/02/2054 | | | |
| Credit Suisse AG AT1 | | 250 | 30 | 0,02 | 1,875 % éch. 12/02/2028 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| Claim | | | | | NCL Corp. Ltd. | | | | 6,000 % éch. 01/02/2054 | | | |
| Deutsche Bank AG | | 200 | 176 | 0,14 | 5,875 % éch. 15/02/2027 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 3,547 % éch. 18/09/2031 | | 200 | 164 | 0,13 | Nissan Motor Co. Ltd. | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 3,742 % éch. 07/01/2033 | | | | | 4,345 % éch. 17/09/2027 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| Discover Financial Services | | 200 | 223 | 0,18 | Petroleos Mexicanos | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 7,964 % éch. 02/11/2034 | | | | | 6,500 % éch. 02/06/2041 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| HSBC Holdings PLC | | 200 | 187 | 0,15 | 6,700 % éch. 16/02/2032 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 3,973 % éch. 22/05/2030 | | | | | Prosus NV | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| ING Groep NV | | 800 | 840 | 0,67 | 3,257 % éch. 19/01/2027 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 6,114 % éch. 11/09/2034 | | | | | Studio City Co. Ltd. | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| Intesa Sanpaolo SpA | | 500 | 413 | 0,33 | 7,000 % éch. 15/02/2027 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 4,198 % éch. 01/06/2032 | | | | | TransDigm, Inc. | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 5,875 % éch. 01/09/2031 | € | 350 | 350 | 0,28 | 6,750 % éch. 15/08/2028 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| (d)(f) | | | | | Venture Global Calcasieu Pass LLC | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| KBC Group NV | \$ | 800 | 846 | 0,68 | 3,875 % éch. 15/08/2029 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 6,324 % éch. 21/09/2034 | | | | | Venture Global LNG, Inc. | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| Nationwide Building Society | £ | 400 | 472 | 0,38 | 9,875 % éch. 01/02/2032 | | | | 6,500 % éch. 01/01/2054 | | | |
| 5,750 % éch. 20/06/2027 | | | | | | | | | 7 470 5,97 | | | |
| (d)(f) | | | | | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES | | | |
| Navient Corp. | \$ | 250 | 242 | 0,19 | Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC | | | | NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES | | | |
| 5,000 % éch. 15/03/2027 | | | | | 1,500 % éch. 17/02/2027 | | | | GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Santander UK Group Holdings PLC | € | 300 | 311 | 0,25 | 1,500 % éch. 17/02/2027 | | | | 1211 Avenue of the Americas Trust | | | |
| 6,534 % éch. 10/01/2029 | | 200 | 277 | 0,22 | ONEOK, Inc. | | | | 4,142 % éch. 10/08/2035 | | | |
| 7,482 % éch. 29/08/2029 | £ | | | | 6,050 % éch. 01/09/2033 | | | | 225 Liberty Street Trust | | | |
| UBS Group AG | \$ | 250 | 198 | 0,16 | Pacific Gas & Electric Co. | | | | 4,501 % éch. 10/02/2036 | | | |
| 4,375 % éch. 10/02/2031 | | | | | 3,000 % éch. 15/06/2028 | | | | 280 Park Avenue Mortgage Trust | | | |
| (d)(f) | | | | | 3,150 % éch. 01/01/2026 | | | | 7,194 % éch. 15/09/2034 | | | |
| 4,875 % éch. 12/02/2027 | | 200 | 181 | 0,14 | 4,450 % éch. 15/04/2042 | | | | Adjustable Rate Mortgage Trust | | | |
| (d)(f) | | | | | 5,250 % éch. 01/03/2052 | | | | 5,710 % éch. 25/08/2036 | | | |
| 6,537 % éch. 12/08/2033 | | 250 | 267 | 0,21 | 5,900 % éch. 01/06/2032 | | | | Alba PLC | | | |
| UniCredit SpA | € | 400 | 394 | 0,31 | 6,700 % éch. 01/04/2053 | | | | 5,599 % éch. 15/12/2038 | | | |
| 4,450 % éch. 03/12/2027 | | | | | Petrobras Global Finance BV | | | | Bridgegate Funding PLC | | | |
| (d)(f) | | | | | 6,850 % éch. 05/06/2115 | | | | 9,220 % éch. 16/10/2062 | | | |
| 5,459 % éch. 30/06/2035 | \$ | 300 | 283 | 0,23 | | | | | 10,220 % éch. 16/10/2062 | | | |
| VICI Properties LP | | 300 | 286 | 0,23 | | | | | Curzon Mortgages PLC | | | |
| 4,500 % éch. 15/01/2028 | | | | | | | | | 6,970 % éch. 28/07/2049 | | | |
| | | | | | | | | | Eurosail PLC | | | |
| | | | | | | | | | 4,398 % éch. 13/03/2045 | | | |
| | | | | | | | | | 4,408 % éch. 13/03/2045 | | | |
| | | | | | | | | | Great Hall Mortgages PLC | | | |
| | | | | | | | | | 5,599 % éch. 18/06/2038 | | | |
| | | | | | | | | | GS Mortgage Securities Corp. Trust | | | |
| | | | | | | | | | 7,659 % éch. 15/11/2032 | | | |
| | | | | | | | | | Harbour Energy PLC | | | |
| | | | | | | | | | 7,220 % éch. 28/01/2054 | | | |
| | | | | | | | | | £ 2 000 2 481 1,98 | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Hospitality Mortgage Trust 7,475 % éch. 15/11/2036 | \$ 178 | \$ 174 | 0,14 | First Franklin Mortgage Loan Trust 4,757 % éch. 25/03/2036 | \$ 733 | \$ 680 | 0,54 | 5,750 % éch. 12/10/2110 | \$ 100 | \$ 90 | 0,07 |
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2,854 % éch. 06/09/2038 | 900 | 832 | 0,66 | Golden Bar Securitisation SRL 6,816 % éch. 22/09/2043 | € 310 | 347 | 0,28 | 6,350 % éch. 09/02/2035 | 200 | 210 | 0,17 |
| Jupiter Mortgage PLC 8,971 % éch. 20/07/2060 | € 900 | 1 145 | 0,92 | 7,516 % éch. 22/09/2043 | 310 | 346 | 0,28 | 10,000 % éch. 05/12/2024 | MXN 10 000 | 588 | 0,47 |
| Lehman XS Trust 5,830 % éch. 25/11/2035 | \$ 432 | 384 | 0,31 | Home Equity Asset Trust 6,130 % éch. 25/04/2036 | \$ 738 | 672 | 0,54 | Obligation internationale du gouvernement roumain 3,750 % éch. 07/02/2034 | € 220 | 210 | 0,17 |
| Mansard Mortgages PLC 5,690 % éch. 15/10/2048 | € 414 | 517 | 0,41 | Long Beach Mortgage Loan Trust 5,790 % éch. 25/10/2036 | 758 | 240 | 0,19 | 5,500 % éch. 18/09/2028 | 150 | 171 | 0,14 |
| Morgan Stanley Capital Trust 6,859 % éch. 15/07/2035 | \$ 450 | 446 | 0,36 | 5,930 % éch. 25/12/2036 | 625 | 224 | 0,18 | 6,375 % éch. 18/09/2033 | 150 | 175 | 0,14 |
| Newgate Funding PLC 5,509 % éch. 01/12/2050 | € 334 | 411 | 0,33 | 6,070 % éch. 25/02/2036 | 357 | 286 | 0,23 | Obligation internationale du gouvernement russe 5,250 % éch. 23/06/2047 ^ | \$ 200 | 71 | 0,06 |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust 6,000 % éch. 25/09/2035 | \$ 222 | 185 | 0,15 | Morgan Stanley Capital, Inc. Trust 6,025 % éch. 25/01/2036 | 900 | 719 | 0,57 | Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 35 760 | 2 047 | 1,64 |
| Stratton Mortgage Funding PLC 8,221 % éch. 20/07/2060 | € 440 | 561 | 0,45 | New Century Home Equity Loan Trust 6,205 % éch. 25/10/2035 | 700 | 592 | 0,47 | Obligation internationale du gouvernement turc 5,250 % éch. 13/03/2030 | \$ 1 000 | 920 | 0,73 |
| Tower Bridge Funding PLC 0,000 % éch. 20/01/2066 (a) | 450 | 575 | 0,46 | Structured Asset Investment Loan Trust 6,445 % éch. 25/05/2035 | 711 | 625 | 0,50 | 5,750 % éch. 11/05/2047 | 250 | 197 | 0,16 |
| Trinity Square PLC 7,970 % éch. 15/07/2059 | 500 | 633 | 0,51 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,760 % éch. 25/07/2036 | 670 | 648 | 0,52 | | | | |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,549 % éch. 25/07/2037 | \$ 516 | 431 | 0,34 | | | 6 243 | 4,99 | | | | |
| | | 18 364 | 14,67 | | | | | | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ACTIONS | | | |
| AREIT LLC 7,470 % éch. 17/08/2041 | 500 | 500 | 0,40 | Obligation internationale du gouvernement argentin 0,750 % éch. 09/07/2030 | 160 | 64 | 0,05 | SERVICES DE COMMUNICATION | | | |
| Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 7,270 % éch. 25/11/2034 | 400 | 364 | 0,29 | 3,500 % éch. 09/07/2041 | 272 | 93 | 0,07 | Intelsat Emergence S.A. (b)(g) | | | |
| | | | | 3,625 % éch. 09/07/2035 | 179 | 61 | 0,05 | 937 | 27 | 0,02 | |
| | | | | 4,250 % éch. 09/01/2038 | 63 | 25 | 0,02 | Total des Valeurs mobilières | | | |
| | | | | Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,500 % éch. 01/03/2026 | CLP 50 000 | 56 | 0,04 | \$ 135 928 | 108,60 | | |
| | | | | Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 1 000 | 1 131 | 0,90 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| | | | | Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 | MXN 7 982 | 416 | 0,33 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| | | | | (c) | | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e) | | | |
| | | | | 4,000 % éch. 30/11/2028 | 8 939 | 516 | 0,41 | 12 383 | 123 | 0,10 | |
| | | | | (c) | | | | Total des Fonds d'investissement | | | |
| | | | | | | | | \$ 123 | 0,10 | | |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|------|----------------------|---------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 1 | \$ 0 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 1 | 2 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 5 | 10 | 0,01 |
| | | | | \$ 12 | 0,01 |
| | | | | \$ 12 | 0,01 |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.EM-36 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2026 | \$ 460 | \$ (1) | 0,00 |
| Indice CDX.EM-38 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2027 | 900 | 1 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 1 400 | 1 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | 4 257 | (26) | (0,02) |
| | | | | \$ (25) | (0,02) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-----------------------------------|-----------|--------------------|----------------------|---|------------------------|
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 % | 16/06/2028 | ¥ 130 000 | \$ (3) | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/12/2028 | 490 000 | (10) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,200 | 15/12/2041 | 30 000 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/06/2032 | 27 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/06/2051 | \$ 450 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 21/12/2052 | 800 | (7) | (0,01) |

Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,350 % | 17/01/2025 | \$ 900 | \$ (1) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 20/12/2024 | 3 800 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 1 750 | 5 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 200 | (1) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 9 850 | 47 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 1 900 | (12) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 200 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,610 | 12/12/2032 | 100 | (1) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 17 600 | 101 | 0,08 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2031 | 1 800 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 8 300 | 22 | 0,02 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2034 | 3 400 | (27) | (0,02) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,512 | 04/01/2027 | BRL 10 200 | 0 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | € 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 200 | 2 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | 100 | 1 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 1 100 | (5) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 400 | (2) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,295 | 30/10/2028 | MXN 19 400 | 1 | 0,00 |
| | | | | | \$ 103 | 0,08 |
| | | | | | \$ 78 | 0,06 |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| DUB | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,790 % | 08/04/2024 | 100 | \$ (1) | \$ 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,790 | 08/04/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 100 | (1) | (2) | (0,01) |
| | | | | | | | \$ (4) | \$ (3) | (0,01) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 % | 20/12/2026 | \$ 200 | \$ (9) | \$ 8 | \$ (1) | 0,00 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 993 | \$ 1 257 | \$ 0 | \$ (9) | \$ (9) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 941 | ¥ 138 828 | 45 | 0 | 45 | 0,04 |
| | 02/2024 | 29 | CNY 204 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 775 | \$ 107 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 82 763 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 135 | 146 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | HKD 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 937 | ¥ 138 000 | 42 | 0 | 42 | 0,03 |
| | 01/2024 | 99 | TRY 2 928 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 31 398 | \$ 1 695 | 0 | (19) | (19) | (0,01) |
| | 02/2024 | TWD 594 | 19 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 51 | CNY 364 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 3 984 | \$ 127 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 8 | IDR 127 761 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | HKD 3 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 792 | ¥ 115 000 | 24 | 0 | 24 | 0,02 |
| | 01/2024 | 263 | TRY 7 825 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 77 | \$ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ 860 | TRY 27 647 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| CBK | 01/2024 | BRL 3 499 | \$ 719 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 6 836 | 388 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 194 | HKD 1 515 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 5 868 | \$ 308 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ 2 628 | BRL 13 482 | 143 | 0 | 143 | 0,11 |
| | 04/2024 | 719 | 3 534 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | BRL 396 | \$ 80 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 977 | 56 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL 23 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 11 | IDR 171 704 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 02/2024 | 82 | BRL 401 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 541 | 2 674 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | 03/2024 | 292 | TWD 9 076 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| MBC | 01/2024 | € 6 197 | \$ 6 813 | 0 | (34) | (34) | (0,03) |
| | 01/2024 | £ 72 | 91 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 156 000 | 1 095 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| | 03/2024 | TWD 4 635 | 147 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 208 | HKD 1 617 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | AUD 4 180 | \$ 2 853 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 30 | 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 30 | CNY 213 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 941 334 | \$ 61 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 37 | IDR 570 536 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 03/2024 | HKD 2 183 | \$ 280 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 7 | IDR 112 046 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | BRL 3 897 | \$ 805 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | CLP 51 719 | 59 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | HKD 10 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 784 | BRL 3 897 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | £ 8 989 | \$ 11 378 | 0 | (82) | (82) | (0,07) |
| | | | | \$ 294 | \$ (221) | \$ 73 | 0,06 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en AUD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 3 292 | AUD 4 965 | \$ 97 | \$ 0 | \$ 97 | 0,09 |
| BOA | 01/2024 | 221 | 334 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | AUD 354 | \$ 236 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| CBK | 01/2024 | 309 | 204 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 123 | AUD 180 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 1 290 | 1 945 | 38 | 0 | 38 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | 1 587 | 2 391 | 46 | 0 | 46 | 0,04 |
| | | | | \$ 188 | \$ (14) | \$ 174 | 0,15 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | \$ 267 | € 245 | \$ 3 | \$ 0 | \$ 3 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € 26 | \$ 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 98 | 106 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 1 983 | € 1 803 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 1 956 | 1 779 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 1 776 | 1 615 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| | | | | \$ 31 | \$ (1) | \$ 30 | 0,02 |

Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 26 | \$ 32 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 031 | £ 814 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | 1 031 | 812 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 17 | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 137 | \$ 173 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 151 | £ 119 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | £ 996 | \$ 1 269 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 58 | 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 25 | £ 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 23 | \$ 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 38 | £ 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 5 626 | 4 448 | 44 | 0 | 44 | 0,04 |
| SSB | 01/2024 | £ 560 | \$ 705 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 3 605 | £ 2 857 | 37 | 0 | 37 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | 5 625 | 4 444 | 41 | 0 | 41 | 0,03 |
| | | | | \$ 135 | \$ (12) | \$ 123 | 0,10 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en JPY (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 42 | ¥ 6 219 | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 10 | 1 535 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 67 | 9 805 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 52 | 7 726 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 85 | 12 484 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | | | | \$ 11 | \$ 0 | \$ 11 | 0,01 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 407 0,33

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/01/2054 | \$ 600 | \$ (582) | (0,47) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (582) | (0,47) |
| Total des Investissements | | \$ 135 966 | 108,63 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (10 806) | (8,63) |
| Actifs nets | | \$ 125 160 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,04 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|--------------|-------|--------------|---------------------|
| Intelsat Emergence S.A. | 24/02/2021 | \$ 77 | \$ 27 | 0,02 |

(h) Un titre d'une juste valeur globale de 3 529 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 462 \$ (31 décembre 2022 : 961 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 31 \$ (31 décembre 2022 : 61 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 135 326 | \$ 602 | \$ 135 928 |
| Fonds d'investissement | 123 | 0 | 0 | 123 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 2 | 495 | 0 | 497 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (582) | 0 | (582) |
| Totaux | \$ 125 | \$ 135 239 | \$ 602 | \$ 135 966 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 56 688 | \$ 282 | \$ 56 970 |
| Fonds d'investissement | 1 740 | 0 | 0 | 1 740 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (4) | 316 | 0 | 312 |
| Totaux | \$ 1 736 | \$ 57 004 | \$ 282 | \$ 59 022 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| MSC | 5,600 % | 19/12/2023 | 03/01/2024 | \$ (2 181) | \$ (2 183) | (1,74) |
| | 5,710 | 19/12/2023 | 04/01/2024 | (1 389) | (1 389) | (1,11) |
| Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (3 572) | (2,85) |

⁽¹⁾ Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 \$ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 97 | \$ 0 | \$ 97 | \$ 3 | \$ 0 | \$ 3 |
| BOA | 50 | 0 | 50 | (65) | 0 | (65) |
| BPS | 16 | 0 | 16 | (73) | 0 | (73) |
| BRC | 12 | 0 | 12 | (5) | 0 | (5) |
| CBK | 109 | 0 | 109 | 24 | 0 | 24 |
| DUB | (1) | 0 | (1) | (2) | 0 | (2) |
| GLM | (3) | 0 | (3) | (36) | 30 | (6) |
| JPM | 16 | 0 | 16 | S/O | S/O | S/O |
| MBC | (8) | 0 | (8) | 22 | 0 | 22 |
| MYC | (1) | 31 | 30 | (8) | 31 | 23 |
| MYI | 12 | 0 | 12 | (10) | 0 | (10) |
| SCX | 44 | 0 | 44 | 27 | 0 | 27 |
| SSB | 48 | 0 | 48 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 16 | 0 | 16 | 3 | 0 | 3 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 44,99 | 55,36 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 63,19 | 45,23 |
| Autres valeurs mobilières | 0,42 | 0,03 |
| Fonds d'investissement | 0,10 | 3,07 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,01 | 0,00 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,06 | 0,76 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,33 | (0,21) |
| Titres vendus à découvert | (0,47) | S/O |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (2,85) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 0,96 | 1,71 |
| Obligations et billets privés | 18,65 | 12,97 |
| Agences du gouvernement américain | 43,99 | 19,84 |
| Obligations du Trésor américain | 19,70 | 35,05 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 14,67 | 17,43 |
| Titres adossés à des actifs | 4,99 | 10,35 |
| Émissions souveraines | 5,62 | 3,23 |
| Actions ordinaires | 0,02 | 0,04 |
| Droits | S/O | 0,00 |
| Fonds d'investissement | 0,10 | 3,07 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,01 | 0,01 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | (0,02) | 0,28 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,08 | 0,48 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,01) | (0,08) |
| Options sur titres | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,01) |
| Contrats de change à terme | 0,06 | (0,27) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,28 | 0,15 |
| Titres vendus à découvert | (0,47) | S/O |
| Autres actifs et passifs à court terme | (8,63) | (4,24) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|--|---------|----------------------------|---------------------|---|---------|----------------------------|---------------------|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|--|
| ACTIONS ORDINAIRES | | | | | | | | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | |
| BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE | | | | | | | | BILLETTS DE TRÉSORERIE | | | | |
| Capri Holdings Ltd. (a) | 800 | \$ 40 | 0,02 | AvalonBay Communities, Inc. | 2 925 | \$ 548 | 0,22 | Arrow Electronics, Inc. | | | | |
| Hilton Worldwide Holdings, Inc. | 550 | 100 | 0,04 | Boston Properties, Inc. | 1 575 | 111 | 0,04 | 5,850 % éch. 10/01/2024 | \$ 250 | \$ 249 | 0,09 | |
| Marriott International, Inc. « A » | 380 | 86 | 0,03 | Brixmor Property Group, Inc. | 2 765 | 64 | 0,03 | 5,900 % éch. 19/01/2024 | 250 | 249 | 0,10 | |
| | | 226 | 0,09 | Camden Property Trust | 2 502 | 249 | 0,10 | AT+T, Inc. | | | | |
| BIENS DE CONSOMMATION COURANTE | | | | | | | | 5,700 % éch. 19/03/2024 | | | | |
| Sovos Brands, Inc. (a) | 1 300 | 29 | 0,01 | COPT Defense Properties | 1 749 | 45 | 0,02 | CIGNA Group | 250 | 249 | 0,10 | |
| ÉNERGIE | | | | | | | | 5,680 % éch. 17/01/2024 | | | | |
| Hess Corp. | 400 | 58 | 0,02 | Crown Castle, Inc. | 1 440 | 166 | 0,07 | Fidelity National Information Services, Inc. | | | | |
| Pioneer Natural Resources Co. | 200 | 45 | 0,02 | CubeSmart | 3 325 | 154 | 0,06 | 5,650 % éch. 05/01/2024 | 250 | 250 | 0,10 | |
| | | 103 | 0,04 | DiamondRock Hospitality Co. | 9 304 | 87 | 0,03 | 5,710 % éch. 16/01/2024 | 250 | 249 | 0,10 | |
| SOINS DE SANTÉ | | | | | | | | Intercontinental Exchange, Inc. | | | | |
| Amedisys, Inc. (a) | 400 | 38 | 0,01 | Digital Realty Trust, Inc. | 4 653 | 626 | 0,25 | 5,600 % éch. 03/01/2024 | 250 | 250 | 0,10 | |
| Cerevel Therapeutics Holdings, Inc. (a) | 1 100 | 47 | 0,02 | Equinix, Inc. | 1 460 | 1 176 | 0,46 | Kindler Morgan, Inc. | | | | |
| ImmunoGen, Inc. (a) | 1 300 | 38 | 0,02 | Equity LifeStyle Properties, Inc. | 5 644 | 398 | 0,16 | 5,700 % éch. 22/01/2024 | 250 | 249 | 0,10 | |
| Karuna Therapeutics, Inc. (a) | 100 | 32 | 0,01 | Essex Property Trust, Inc. | 557 | 138 | 0,06 | Marathon Oil Corp. | | | | |
| RayzeBio, Inc. (a) | 400 | 25 | 0,01 | Extra Space Storage, Inc. | 1 393 | 223 | 0,09 | 6,050 % éch. 03/01/2024 | 250 | 250 | 0,10 | |
| | | 180 | 0,07 | First Industrial Realty Trust, Inc. | 6 668 | 351 | 0,14 | Quanta Services, Inc. | | | | |
| TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION | | | | | | | | 5,900 % éch. 08/01/2024 | | | | |
| Splunk, Inc. (a) | 400 | 61 | 0,03 | Gaming and Leisure Properties, Inc. | 5 819 | 287 | 0,11 | Southern California Edison Co. | | | | |
| MATÉRIAUX | | | | | | | | 5,730 % éch. 16/01/2024 | | | | |
| United States Steel Corp. | 1 100 | 53 | 0,02 | Healthpeak Properties, Inc. | 11 757 | 233 | 0,09 | 5,730 % éch. 17/01/2024 | 500 | 498 | 0,19 | |
| IMMOBILIER | | | | | | | | VW Credit, Inc. | | | | |
| Howard Hughes Holdings, Inc. (a) | 1 891 | 162 | 0,06 | Host Hotels & Resorts, Inc. | 11 538 | 225 | 0,09 | 5,640 % éch. 03/01/2024 | 250 | 250 | 0,10 | |
| SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | | | | | | | | | |
| PNM Resources, Inc. | 324 | 13 | 0,01 | InvenTrust Properties Corp. | 3 367 | 85 | 0,03 | | | | | |
| | | 827 | 0,33 | Invitation Homes, Inc. | 16 974 | 579 | 0,23 | | | | | |
| TITRES PRIVILÉGIÉS | | | | | | | | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 813 | 135 | 0,05 | Kilroy Realty Corp. | 3 195 | 127 | 0,05 | 10,900 % éch. | | | | |
| SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER | | | | | | | | 04/01/2024 (b)(c) HUF 93 000 | | | | |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc. | 2 453 | 311 | 0,12 | Kimco Realty Corp. | 5 012 | 107 | 0,04 | Total des Instruments à court terme | | 4 400 | 1,74 | |
| American Assets Trust, Inc. | 4 191 | 94 | 0,04 | Mid-America Apartment Communities, Inc. | 316 | 43 | 0,02 | | | | | |
| American Homes 4 Rent « A » | 11 518 | 414 | 0,16 | National Storage Affiliates Trust | 2 487 | 103 | 0,04 | Total des Valeurs mobilières | \$ 289 304 | 114,24 | | |
| American Tower Corp. | 1 336 | 288 | 0,11 | Park Hotels & Resorts, Inc. | 11 538 | 177 | 0,07 | ACTIONS | | | | |
| Americold Realty Trust, Inc. | 5 937 | 180 | 0,07 | Prologis, Inc. | 12 258 | 1 634 | 0,65 | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | |
| Apartment Income REIT Corp. | 4 071 | 141 | 0,06 | Public Storage | 2 443 | 745 | 0,29 | PIMCO Select Funds plc - | | | | |
| | | | | Realty Income Corp. | 6 617 | 380 | 0,15 | Fonds PIMCO | | | | |
| | | | | Regency Centers Corp. | 1 453 | 97 | 0,04 | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | | | | |
| | | | | Retail Opportunity Investments Corp. | 7 800 | 110 | 0,04 | 187 197 | 1 865 | 0,74 | | |
| | | | | Rexford Industrial Realty, Inc. | 4 066 | 228 | 0,09 | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | | |
| | | | | RLJ Lodging Trust | 23 571 | 276 | 0,11 | Invesco Physical Gold ETC | | | | |
| | | | | Ryman Hospitality Properties, Inc. | 2 558 | 282 | 0,11 | 74 145 | 14 779 | 5,84 | | |
| | | | | SBA Communications Corp. | 1 114 | 283 | 0,11 | iShares Physical Gold ETC | 288 780 | 11 612 | 4,58 | |
| | | | | Simon Property Group, Inc. | 6 100 | 870 | 0,34 | | | 26 391 | 10,42 | |
| | | | | SITE Centers Corp. | 8 801 | 120 | 0,05 | Total des Fonds d'investissement | | | | |
| | | | | Sun Communities, Inc. | 2 529 | 338 | 0,13 | \$ 28 256 | 11,16 | | | |
| | | | | Sunstone Hotel Investors, Inc. | 12 397 | 133 | 0,05 | | | | | |
| | | | | Terreno Realty Corp. | 2 081 | 130 | 0,05 | | | | | |
| | | | | UDR, Inc. | 4 825 | 185 | 0,07 | | | | | |
| | | | | Ventas, Inc. | 4 758 | 237 | 0,09 | | | | | |
| | | | | VICI Properties, Inc. | 18 101 | 577 | 0,23 | | | | | |
| | | | | WP Carey, Inc. | 3 447 | 223 | 0,09 | | | | | |
| | | | | | | 14 973 | 5,91 | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| SSB | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 364 | Billets du Trésor américain 0,250 % échéance 31/07/2025 | \$ (371) | \$ 364 | \$ 364 | 0,14 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | \$ (371) | \$ 364 | 0,14 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars | Court | 03/2024 | 8 | \$ (6) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 1 | (2) | 0,00 |

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 17 | \$ (36) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 40 | 191 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Court | 03/2024 | 51 | (51) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 57 | (1) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 23 | (291) | (0,12) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 63 | 259 | 0,10 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 171 | (128) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 44 | 101 | 0,04 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 374 | (903) | (0,36) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 109 | 18 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 50 | (256) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 78 | (714) | (0,28) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 41 | (530) | (0,21) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 55 | 244 | 0,10 |
| | | | | \$ (2 105) | (0,83) |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE STYLE CONTRAT À TERME STANDARDISÉ SUR DES CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

| Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Nbre de Contrats | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-----------------|-------------------|------------------|----------|--------------|---------------------|
| Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur ICE Euribor avril 2024 | \$ 96,750 | 12/04/2024 | 185 | \$ (125) | \$ (125) | (0,05) |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ (2 230) (0,88)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers €)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|------------------------|
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 0,500 % | 16/03/2042 | £ 2 200 | \$ 83 | 0,03 |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/06/2052 | 6 500 | (1 906) | (0,75) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 4 000 | (666) | (0,26) |
| À payer ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 3 500 | 284 | 0,11 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 16/06/2031 | ¥ 50 000 | 15 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,450 | 20/03/2029 | 154 390 | 47 | 0,02 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 15/12/2031 | 77 000 | 7 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,550 | 14/09/2028 | 1 950 000 | (73) | (0,03) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,840 | 21/11/2028 | \$ 3 100 | 286 | 0,11 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,888 | 21/11/2053 | 600 | (193) | (0,08) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,237 | 21/11/2053 | 2 300 | 448 | 0,18 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,340 | 21/11/2028 | 11 200 | (638) | (0,25) |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,865 | 13/02/2054 | 10 900 | 644 | 0,25 |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,085 | 13/02/2034 | 24 600 | (535) | (0,21) |
| À payer ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 22/03/2026 | 10 400 | 17 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 66 900 | (228) | (0,09) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,606 | 31/10/2025 | 29 600 | 340 | 0,13 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,611 | 31/10/2025 | 5 500 | 64 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,868 | 22/12/2025 | 10 400 | (108) | (0,04) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,190 | 04/11/2052 | € 200 | 87 | 0,03 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,195 | 04/11/2052 | 200 | 100 | 0,04 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,197 | 08/11/2052 | 400 | 174 | 0,07 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | 600 | (39) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 300 | (18) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 300 | (19) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 600 | (30) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 200 | (10) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 11 180 | (1 594) | (0,63) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,879 | 15/08/2032 | 8 400 | 256 | 0,10 |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 35 010 | 2 523 | 1,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 40 400 | (713) | (0,28) |
| À payer | CPTFEMU | 2,356 | 15/11/2033 | 1 800 | 44 | 0,02 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,359 | 15/08/2030 | 1 400 | 26 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,363 | 15/11/2033 | 1 100 | 26 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,390 | 15/11/2033 | 1 000 | 26 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,470 | 15/07/2032 | 1 100 | 19 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,548 | 15/11/2053 | 400 | (13) | (0,01) |
| À payer | CPTFEMU | 2,590 | 15/12/2052 | 500 | 17 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,600 | 15/05/2032 | 2 400 | 37 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,620 | 15/11/2053 | 200 | (12) | 0,00 |
| À payer | CPTFEMU | 2,680 | 15/04/2053 | 2 100 | 163 | 0,06 |
| À payer | CPTFEMU | 2,682 | 15/10/2053 | 300 | 24 | 0,01 |
| À payer | CPTFEMU | 2,700 | 15/04/2053 | 2 300 | 147 | 0,06 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,720 | 15/06/2032 | 4 200 | (37) | (0,01) |
| À payer | CPTFEMU | 2,736 | 15/10/2053 | 500 | 45 | 0,02 |
| À payer | CPTFEMU | 2,763 | 15/09/2053 | 1 100 | 117 | 0,05 |

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | CPTFEMU | 2,965 % | 15/05/2027 | € 10 700 | \$ 224 | 0,09 |
| À recevoir | CPTFEMU | 2,980 | 15/06/2027 | 9 900 | 27 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 3,000 | 15/05/2027 | 1 900 | 35 | 0,01 |
| À recevoir | CPTFEMU | 3,130 | 15/05/2027 | 2 100 | 24 | 0,01 |
| À payer | CPURNSA | 1,280 | 19/05/2030 | \$ 600 | (39) | (0,02) |
| À recevoir | CPURNSA | 1,794 | 24/08/2027 | 850 | 60 | 0,02 |
| À recevoir | CPURNSA | 1,798 | 25/08/2027 | 300 | 21 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 1,890 | 27/08/2027 | 500 | 36 | 0,01 |
| À payer | CPURNSA | 1,954 | 03/06/2029 | 750 | (55) | (0,02) |
| À payer | CPURNSA | 2,165 | 16/04/2029 | 500 | (38) | (0,02) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,314 | 26/02/2026 | 400 | 30 | 0,01 |
| À payer | CPURNSA | 2,353 | 09/05/2028 | 300 | (24) | (0,01) |
| À payer | CPURNSA | 2,360 | 09/05/2028 | 450 | (36) | (0,01) |
| À payer | CPURNSA | 2,364 | 10/05/2028 | 460 | (36) | (0,01) |
| À payer | CPURNSA | 2,379 | 09/07/2028 | 300 | (24) | (0,01) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,419 | 05/03/2026 | 700 | 52 | 0,02 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,703 | 25/05/2026 | 300 | 23 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,768 | 13/05/2026 | 500 | 38 | 0,01 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,813 | 14/05/2026 | 300 | 23 | 0,01 |
| À payer | FRCPXTOB | 1,280 | 15/11/2034 | € 200 | (35) | (0,01) |
| À payer | FRCPXTOB | 1,590 | 15/02/2028 | 180 | (25) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,480 | 15/01/2030 | £ 800 | (178) | (0,07) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,566 | 15/03/2036 | 500 | (90) | (0,04) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 3,850 | 15/09/2024 | 400 | (90) | (0,04) |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,143 | 15/10/2032 | 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,288 | 15/02/2032 | 2 500 | 165 | 0,07 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,595 | 15/08/2032 | 4 600 | (247) | (0,10) |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,615 | 15/02/2027 | 4 900 | 229 | 0,09 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 4,735 | 15/12/2026 | 400 | 45 | 0,02 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 5,200 | 15/06/2024 | 1 300 | 67 | 0,03 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 5,330 | 15/06/2024 | 1 800 | 87 | 0,03 |
| À recevoir | IPC Royaume-Uni | 6,600 | 15/05/2024 | 800 | 43 | 0,02 |
| | | | | | \$ (455) | (0,18) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (455) | (0,18) |

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

| Contrepartie | Description | Indice initial | Taux variable | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|----------------|---|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| GLM | Taux plafond - CPALEMU hors cote | \$ 100,151 | Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0 | 22/06/2035 | 300 | \$ (14) | \$ (11) | (0,01) |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,700 % | 13/02/2024 | 19 300 | \$ (84) | \$ (286) | (0,11) |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,760 | 16/01/2024 | 15 800 | (73) | (223) | (0,09) |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,900 | 20/03/2024 | 20 800 | (100) | (116) | (0,05) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,900 | 29/08/2025 | 4 000 | (52) | (87) | (0,03) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,900 | 29/08/2025 | 4 000 | (52) | (20) | (0,01) |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,800 | 01/09/2025 | 22 800 | (288) | (465) | (0,18) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,800 | 01/09/2025 | 22 800 | (288) | (126) | (0,05) |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,758 | 16/01/2024 | 3 200 | (15) | (45) | (0,02) |
| | | | | | | | \$ (952) | \$ (1 368) | (0,54) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|------|
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17/11/2059 | \$ 200 | \$ (6) | \$ 6 | \$ 0 | 0,00 | |
| MYC | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 800 | (26) | 26 | 0 | 0,00 | |
| SAL | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 200 | 0 | (1) | (1) | 0,00 | |
| UAG | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 400 | (12) | 12 | 0 | 0,00 | |
| | | | | | | \$ (44) | \$ 43 | \$ (1) | 0,00 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MYC | À recevoir | CPURNSA | 1,800 % | 20/07/2026 | \$ 600 | \$ 0 | \$ (89) | \$ (89) | (0,04) |
| | À recevoir | CPURNSA | 1,805 | 20/09/2026 | 50 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | À recevoir | CPURNSA | 1,810 | 19/07/2026 | 500 | 0 | (73) | (73) | (0,03) |
| | | | | | | \$ 0 | \$ (169) | \$ (169) | (0,07) |

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-----------------------|----------------------------|---|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK | À recevoir | Indice TRNGLU Index | 2 377 | LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné | \$ 11 726 | 10/07/2024 | \$ 0 | \$ (32) | \$ (32) | (0,01) |
| JPM | À recevoir | Indice JMABDEWU Index | 1 627 | 0,053 % | 263 | 15/02/2024 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | À recevoir | Indice JMABNIU5 Index | 95 050 | 0,000 | 17 075 | 15/02/2024 | 0 | (153) | (153) | (0,06) |
| MAC | À recevoir | Indice PIMCOBDV Index | 43 741 | 0,600 | 5 688 | 16/01/2024 | 0 | 30 | 30 | 0,01 |
| | À recevoir | Indice PIMCOBDU Index | 213 477 | 0,150 | 33 758 | 15/03/2024 | (4) | (204) | (208) | (0,08) |
| | | | | | | | \$ (4) | \$ (360) | \$ (364) | (0,14) |

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-------------------|----------------------------|---|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À payer | Exxon Mobil Corp. | 465 | LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 46 | 16/10/2024 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| MYI | À payer | Chevron Corp. | 410 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 61 | 24/04/2024 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ | 10 278 | \$ 13 011 | \$ 0 | \$ (92) | (0,04) |
| | 02/2024 | \$ | 1 238 | CNY 8 749 | 0 | (1) | (1) |
| | 03/2024 | CNH | 29 439 | \$ 4 095 | 0 | (63) | (63) |
| | 03/2024 | \$ | 423 | INR 35 363 | 1 | 0 | 1 |
| | 06/2024 | | 2 593 | KRW 3 331 080 | 0 | 0 | 0 |
| | 01/2024 | CAD | 8 499 | \$ 6 280 | 0 | (166) | (166) |
| | 01/2024 | DKK | 26 216 | 3 865 | 0 | (21) | (21) |
| | 01/2024 | € | 36 605 | 39 940 | 0 | (505) | (505) |
| | 01/2024 | £ | 2 063 | 2 616 | 0 | (13) | (13) |
| | 01/2024 | HUF | 18 014 | 51 | 0 | (1) | (1) |
| | 01/2024 | ¥ | 174 300 | 1 185 | 0 | (53) | (53) |
| | 01/2024 | KRW | 65 689 | 50 | 0 | (1) | (1) |
| BPS | 01/2024 | PLN | 560 | 133 | 0 | (9) | (9) |
| | 01/2024 | \$ | 309 | DKK 2 100 | 2 | 0 | 2 |
| | 01/2024 | | 149 | € 135 | 0 | 0 | 0 |
| | 01/2024 | | 1 | HUF 351 | 0 | 0 | 0 |
| | 01/2024 | | 50 | IDR 773 309 | 0 | 0 | 0 |
| | 01/2024 | | 1 891 | ZAR 35 052 | 23 | 0 | 23 |
| | 02/2024 | CNY | 3 210 | \$ 451 | 0 | (2) | (2) |
| | 02/2024 | \$ | 995 | CNY 7 065 | 3 | 0 | 3 |
| | 02/2024 | | 867 | TWD 27 561 | 44 | 0 | 44 |
| | 03/2024 | IDR | 2 443 193 | \$ 153 | 0 | (5) | (5) |
| | 03/2024 | TWD | 3 717 | 118 | 0 | (5) | (5) |
| | 03/2024 | \$ | 1 469 | INR 122 832 | 2 | 0 | 2 |
| BRC | 01/2024 | CHF | 37 | \$ 42 | 0 | (2) | (2) |
| | 01/2024 | KRW | 64 615 | 50 | 0 | 0 | 0 |
| | 01/2024 | MXN | 2 156 | 124 | 0 | (3) | (3) |
| | 01/2024 | \$ | 1 068 | MXN 18 744 | 33 | 0 | 33 |
| | 01/2024 | | 2 486 | PLN 10 872 | 278 | 0 | 278 |
| | 01/2024 | | 2 008 | TRY 61 127 | 32 | 0 | 32 |
| | 01/2024 | | 50 | ZAR 924 | 1 | 0 | 1 |
| | 03/2024 | TRY | 2 342 | \$ 75 | 0 | 0 | 0 |
| | 03/2024 | \$ | 1 149 | IDR 17 869 073 | 9 | 0 | 9 |
| | 03/2024 | | 1 | THB 30 | 0 | 0 | 0 |
| | 01/2024 | BRL | 8 875 | \$ 1 823 | 0 | (4) | (4) |
| | 01/2024 | COP | 950 253 | 241 | 0 | (4) | (4) |
| 01/2024 | DKK | 1 315 | 192 | 0 | (3) | (3) | |
| 01/2024 | HUF | 2 352 | 7 | 0 | 0 | 0 | |
| 01/2024 | IDR | 771 427 | 50 | 0 | 0 | 0 | |
| 01/2024 | ¥ | 58 000 | 408 | 0 | (4) | (4) | |

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|--------|
| | 01/2024 | MXN | 6 628 | \$ 376 | \$ 0 | \$ (14) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 190 | CHF 166 | 7 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 478 | COP 1 904 395 | 13 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 346 | ZAR 6 580 | 13 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | ZAR | 855 | \$ 45 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 02/2024 | CNY | 2 018 | | 0 | (5) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 50 | IDR 771 625 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 644 | ILS 2 346 | 9 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 304 | PEN 1 143 | 4 | 0 | 0,00 | |
| | 04/2024 | | 1 823 | BRL 8 965 | 8 | 0 | 0,00 | |
| DUB | 06/2024 | KRW | 1 326 248 | \$ 1 016 | 0 | (16) | (0,01) | |
| | 01/2024 | | 64 985 | 50 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 3 293 | SGD 4 359 | 23 | 0 | 0,01 | |
| FAR | 06/2024 | | 800 | KRW 1 041 676 | 11 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 02/2024 | CNY | 917 | \$ 128 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | CAD | 66 | 50 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | DKK | 31 916 | 4 708 | 0 | (23) | (0,01) | |
| | 01/2024 | HUF | 49 512 | 133 | 0 | (10) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 411 943 | 2 802 | 0 | (122) | (0,05) | |
| | 01/2024 | \$ | 1 885 | BRL 9 494 | 70 | 0 | 0,03 | |
| | 01/2024 | | 4 171 | MXN 73 168 | 130 | 0 | 0,05 | |
| | 01/2024 | ZAR | 952 | \$ 50 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 46 381 | 3 | 0 | 0 | 0,00 | |
| JPM | 06/2024 | KRW | 1 330 993 | 1 024 | 0 | (12) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 69 340 | 198 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 50 | IDR 769 350 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 50 | KRW 64 807 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 02/2024 | | 1 550 | BRL 7 601 | 12 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | IDR | 71 066 | \$ 5 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 440 | INR 36 816 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 2 279 | TWD 70 862 | 69 | 0 | 0,03 | |
| MBC | 06/2024 | KRW | 64 252 | \$ 50 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | AUD | 3 878 | 2 570 | 0 | (77) | (0,03) | |
| | 01/2024 | £ | 215 | 272 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 492 | £ 388 | 3 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 181 | HUF 433 259 | 68 | 0 | 0,03 | |
| | 03/2024 | TRY | 6 062 | \$ 194 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | TWD | 370 | 12 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 785 | PHP 43 917 | 8 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | HUF | 3 299 | \$ 9 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | PLN | 519 | 130 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 1 674 | DKK 11 400 | 15 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 837 | € 757 | 1 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 862 | MYR 8 690 | 34 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 20 | SGD 26 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 2 525 | \$ 135 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 02/2024 | \$ | 2 494 | CNY 17 662 | 3 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 758 | IDR 27 059 536 | 0 | (3) | 0,00 | |
| RBC | 06/2024 | | 461 | KRW 599 027 | 6 | 0 | 0,00 | |
| SCX | 04/2024 | | 6 | MXN 107 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 399 | ¥ 58 100 | 14 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 580 | MXN 10 184 | 19 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 282 | SEK 2 929 | 9 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 365 | ZAR 6 920 | 13 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | TWD | 96 494 | \$ 3 102 | 0 | (95) | (0,04) | |
| | 03/2024 | \$ | 396 | HKD 3 086 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 3 000 | INR 250 894 | 5 | 0 | 0,00 | |
| SOG | 03/2024 | | 1 972 | THB 68 156 | 38 | 0 | 0,01 | |
| | 02/2024 | | 772 | RON 3 542 | 14 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | TWD | 3 952 | \$ 125 | 0 | (6) | 0,00 | |
| SSB | 01/2024 | \$ | 629 | CLP 556 000 | 7 | 0 | 0,00 | |
| TOR | 01/2024 | ¥ | 2 330 009 | \$ 15 884 | 0 | (653) | (0,26) | |
| UAG | 01/2024 | BRL | 614 | 124 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 87 | MXN 1 528 | 3 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 145 | ZAR 2 762 | 6 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | THB | 4 468 | \$ 129 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 03/2024 | \$ | 1 560 | CZK 34 726 | 0 | (9) | 0,00 | |
| | | | | | \$ 1 064 | \$ (2 025) | \$ (961) | (0,38) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en AUD (partiellement couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| AZD | 01/2024 | \$ | 75 | AUD 113 | \$ 2 | \$ 0 | 2 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD | 1 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | \$ | 0 | KRW 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | | 40 | AUD 60 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | | 57 | 85 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | | \$ 5 | \$ 0 | \$ 5 | 0,00 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation, E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 660 | \$ 1 814 | \$ 1 | \$ (21) | \$ (20) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 1 704 | € 1 561 | 22 | 0 | 22 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | € 1 522 | \$ 1 659 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | 863 | 935 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 37 845 | € 34 421 | 187 | 0 | 187 | 0,07 |
| MYI | 01/2024 | 37 729 | 34 327 | 199 | 0 | 199 | 0,08 |
| UAG | 01/2024 | 8 776 | 7 978 | 39 | 0 | 39 | 0,02 |
| | | | | \$ 448 | \$ (63) | \$ 385 | 0,15 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (partiellement couverte) de capitalisation et E en GBP (partiellement couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 146 | £ 115 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 237 | 187 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | KRW 3 045 | \$ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | £ 5 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | \$ 4 | £ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 6 | \$ 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 | £ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| NGF | 01/2024 | £ 7 | \$ 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | 142 | 179 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | \$ 1 425 | £ 1 127 | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | £ 3 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 369 | £ 1 082 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | | | | \$ 24 | \$ (2) | \$ 22 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Administrations en SGD (couverte) de distribution II et E en SGD (partiellement couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 234 | SGD 312 | \$ 3 | \$ 0 | \$ 3 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 2 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | 187 | 249 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD 32 | \$ 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 20 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | \$ 1 219 | SGD 1 626 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 02/2024 | SGD 23 | \$ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | \$ 1 325 | SGD 1 768 | 15 | 0 | 15 | 0,01 |
| | 02/2024 | SGD 17 | \$ 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 34 | \$ 0 | \$ 34 | 0,02 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (2 428) (0,96)

Total des Investissements

\$ 312 811 123,52

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (59 563) (23,52)

Actifs nets

\$ 253 248 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 15 168 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(h) Un titre d'une juste valeur globale de 1 225 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 4 010 \$ (31 décembre 2022 : 5 919 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 2 460 \$ (31 décembre 2022 : 2 260 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 15 799 | \$ 273 301 | \$ 204 | \$ 289 304 |
| Fonds d'investissement | 28 256 | 0 | 0 | 28 256 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 364 | 0 | 364 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 54 | (5 167) | 0 | (5 113) |
| Totaux | \$ 44 109 | \$ 268 498 | \$ 204 | \$ 312 811 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 8 543 | \$ 311 578 | \$ 0 | \$ 320 121 |
| Fonds d'investissement | 68 975 | 0 | 0 | 68 975 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 40 720 | 0 | 40 720 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 1 933 | 2 088 | 0 | 4 021 |
| Totaux | \$ 79 451 | \$ 354 386 | \$ 0 | \$ 433 837 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| GRE | 5,520 % | 14/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (11 818) | \$ (11 850) | (4,68) |
| | 5,520 | 18/12/2023 | 04/01/2024 | (3 206) | (3 213) | (1,27) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (15 063) | (5,95) |

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | En % de l'actif net |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|---|---------------------|
| TDM | 5,530 % | 19/12/2023 | 02/01/2024 | \$ (1 226) | \$ (1 229) | (0,49) |
| Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (1 229) | (0,49) |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 |
| BOA | (151) | 0 | (151) | 441 | (240) | 201 |
| BPS | (990) | 1 250 | 260 | (230) | 620 | 390 |
| BRC | 348 | (370) | (22) | 170 | 170 | 340 |
| CBK | (53) | (1 080) | (1 133) | 430 | (240) | 190 |
| DUB | 34 | 0 | 34 | (119) | 0 | (119) |
| FAR | (225) | 0 | (225) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | (203) | 0 | (203) | 557 | (550) | 7 |
| GST | (591) | 560 | (31) | (118) | 260 | 142 |
| JPM | (73) | 0 | (73) | 40 | 400 | 440 |
| MAC | (178) | 0 | (178) | 192 | 0 | 192 |
| MBC | 169 | (360) | (191) | 375 | (200) | 175 |
| MYC | (214) | 260 | 46 | (176) | 260 | 84 |
| MYI | 262 | (480) | (218) | (336) | 550 | 214 |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (21) | 0 | (21) |
| RYL | (2) | 10 | 8 | S/O | S/O | S/O |
| SAL | (1) | 0 | (1) | (2) | 0 | (2) |
| SCX | 15 | 0 | 15 | 2 207 | (260) | 1 947 |
| SOG | 8 | 0 | 8 | 66 | 0 | 66 |
| SSB | 7 | 0 | 7 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (638) | 380 | (258) | 1 | 0 | 1 |
| UAG | 46 | 0 | 46 | 475 | (530) | (55) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 79,26 | 53,86 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 34,78 | 24,35 |
| Autres valeurs mobilières | 0,20 | 1,21 |
| Fonds d'investissement | 11,16 | 17,11 |
| Contrats de mise en pension | 0,14 | 10,10 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,88) | 0,49 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,18) | (0,47) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,96) | 0,98 |
| Contrats de prise en pension | (5,95) | S/O |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (0,49) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 2,83 | 3,02 |
| Agences du gouvernement américain | 27,20 | 10,47 |
| Obligations du Trésor américain | 33,95 | 29,26 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 4,33 | 4,06 |
| Titres adossés à des actifs | 4,24 | 3,00 |
| Émissions souveraines | 33,66 | 20,01 |
| Actions ordinaires | 0,33 | 0,37 |
| Titres privilégiés | 0,05 | 0,14 |
| Sociétés d'investissement immobilier | 5,91 | 1,75 |
| Instruments à court terme | 1,74 | 7,34 |
| Fonds d'investissement | 11,16 | 17,11 |
| Contrats de mise en pension | 0,14 | 10,10 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,83) | 0,49 |
| Options vendues | | |
| Options de style contrat à terme standardisé sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | (0,05) | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,18) | (0,47) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,14 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Options plafonnées sur l'inflation | (0,01) | (0,01) |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,54) | (0,23) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,07) | (0,04) |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,14) | (0,20) |
| Swaps de rendement total sur titres | 0,00 | S/O |
| Contrats de change à terme | (0,38) | 0,33 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,18 | 0,99 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (23,52) | (7,63) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 6,000 % éch. 01/04/2035 - 01/01/2041 | \$ 848 | \$ 886 | 0,11 |
| 6,500 % éch. 01/12/2035 - 01/01/2036 | 6 | 7 | 0,00 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 4,000 % éch. 01/01/2054 | 19 600 | 18 545 | 2,29 |
| 4,500 % éch. 01/02/2054 | 42 600 | 41 324 | 5,10 |
| 5,000 % éch. 01/01/2054 | 70 400 | 69 678 | 8,60 |
| 5,500 % éch. 01/02/2054 | 6 300 | 6 329 | 0,78 |
| | <u>276 596</u> | <u>34,15</u> | |

OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Billets du Trésor américain | | | |
| 0,250 % éch. 31/05/2025 | 27 900 | 26 280 | 3,24 |
| 0,375 % éch. 31/01/2026 (e) | 139 800 | 129 181 | 15,95 |
| 2,875 % éch. 15/05/2032 | 1 800 | 1 669 | 0,21 |
| 4,250 % éch. 31/12/2024 (f) | 65 300 | 64 955 | 8,02 |
| 4,250 % éch. 31/05/2025 (f) | 19 800 | 19 730 | 2,44 |
| 4,375 % éch. 15/08/2026 (e) | 26 200 | 26 381 | 3,26 |
| 4,375 % éch. 30/11/2028 | 31 200 | 31 931 | 3,94 |
| 4,750 % éch. 31/07/2025 (e) | 39 300 | 39 484 | 4,88 |
| 4,875 % éch. 30/11/2025 | 27 600 | 27 888 | 3,44 |
| 5,000 % éch. 31/08/2025 (e) | 47 600 | 48 045 | 5,93 |
| 5,000 % éch. 30/09/2025 (e) | 42 000 | 42 432 | 5,24 |
| | <u>457 976</u> | <u>56,55</u> | |

**TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES
NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES
GOUVERNEMENTAUX**

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Banc of America Mortgage Trust | | | |
| 5,267 % éch. 25/07/2034 | 11 | 9 | 0,00 |
| 5,274 % éch. 25/08/2034 | 202 | 193 | 0,02 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | | | |
| 4,746 % éch. 25/07/2034 | 114 | 105 | 0,01 |
| 5,125 % éch. 25/01/2035 | 6 | 5 | 0,00 |
| 5,652 % éch. 25/01/2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| Bear Stearns ALT-A Trust | | | |
| 5,446 % éch. 25/12/2033 | 25 | 24 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/02/2034 | 46 | 43 | 0,01 |
| Benchmark Mortgage Trust | | | |
| 3,965 % éch. 10/04/2051 | 866 | 844 | 0,10 |
| Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc. | | | |
| 7,000 % éch. 25/12/2018 | 1 | 1 | 0,00 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust | | | |
| 7,780 % éch. 25/10/2035 | 13 | 13 | 0,00 |
| Countrywide Alternative Loan Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/10/2033 | 9 | 9 | 0,00 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | |
| 4,765 % éch. 25/11/2034 | 28 | 25 | 0,00 |
| 5,003 % éch. 20/02/2035 | 7 | 7 | 0,00 |
| DBGS Mortgage Trust | | | |
| 6,254 % éch. 15/06/2033 | 2 800 | 2 573 | 0,32 |
| Eurosail PLC | | | |
| 6,289 % éch. 13/06/2045 | £ 3 458 | 4 381 | 0,54 |
| Formentera Issuer PLC | | | |
| 6,020 % éch. 28/07/2047 | 2 266 | 2 885 | 0,36 |
| Great Hall Mortgages PLC | | | |
| 5,812 % éch. 18/06/2039 | \$ 267 | 265 | 0,03 |
| GSR Mortgage Loan Trust | | | |
| 4,836 % éch. 25/09/2035 | 67 | 63 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/03/2032 | 0 | 0 | 0,00 |
| IndyMac Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,950 % éch. 25/04/2035 | 259 | 213 | 0,03 |
| Morgan Stanley Capital Trust | | | |
| 6,559 % éch. 15/07/2035 | 4 260 | 4 225 | 0,52 |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,332 % éch. 25/10/2034 | 248 | 232 | 0,03 |
| MortgageIT Trust | | | |
| 6,110 % éch. 25/02/2035 | 54 | 51 | 0,01 |
| Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass- Through Certificates | | | |
| 6,030 % éch. 25/12/2035 | 250 | 231 | 0,03 |
| Prime Mortgage Trust | | | |
| 5,870 % éch. 25/02/2034 | 2 | 1 | 0,00 |
| Primrose Residential DAC | | | |
| 4,626 % éch. 24/03/2061 | € 2 629 | 2 895 | 0,36 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Ripon Mortgages PLC | | | |
| 5,920 % éch. 28/08/2056 | £ 3 966 | \$ 5 041 | 0,62 |
| Sequoia Mortgage Trust | | | |
| 5,892 % éch. 20/06/2036 | \$ 197 | 182 | 0,02 |
| 6,272 % éch. 20/10/2027 | 1 | 1 | 0,00 |
| Stratton Mortgage Funding PLC | | | |
| 6,121 % éch. 20/07/2060 | £ 2 470 | 3 149 | 0,39 |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | |
| 4,351 % éch. 25/01/2035 | \$ 124 | 122 | 0,02 |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust | | | |
| 5,970 % éch. 19/07/2035 | 13 | 12 | 0,00 |
| Thornburg Mortgage Securities Trust | | | |
| 6,150 % éch. 25/04/2043 | 0 | 0 | 0,00 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC | | | |
| 6,365 % éch. 20/10/2051 | £ 1 853 | 2 365 | 0,29 |
| 6,570 % éch. 20/05/2045 | 4 545 | 5 803 | 0,72 |
| 6,571 % éch. 20/07/2045 | 2 237 | 2 860 | 0,35 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | |
| 6,150 % éch. 25/01/2045 | \$ 397 | 374 | 0,05 |
| 6,412 % éch. 25/06/2042 | 4 | 4 | 0,00 |
| Warwick Finance Residential Mortgages PLC | | | |
| 6,170 % éch. 21/12/2049 | £ 805 | 1 029 | 0,13 |
| Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust | | | |
| 3,995 % éch. 15/05/2047 | \$ 4 300 | 4 248 | 0,52 |
| | <u>44 489</u> | <u>5,49</u> | |

TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Ameriqueq Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass- Through Certificates | | | |
| 6,490 % éch. 25/10/2034 | 780 | 771 | 0,10 |
| Ares European CLO DAC | | | |
| 4,843 % éch. 20/04/2032 | € 3 100 | 3 370 | 0,42 |
| Avoca CLO DAC | | | |
| 4,785 % éch. 15/10/2032 | 3 000 | 3 273 | 0,40 |
| Barings Euro CLO DAC | | | |
| 4,836 % éch. 25/11/2029 | 432 | 477 | 0,06 |
| Black Diamond CLO DAC | | | |
| 4,982 % éch. 15/05/2032 | 2 638 | 2 877 | 0,36 |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | |
| 4,685 % éch. 15/01/2031 | 2 384 | 2 605 | 0,32 |
| BNPP AM Euro CLO DAC | | | |
| 4,822 % éch. 22/07/2032 | 3 000 | 3 271 | 0,40 |
| Bridgepoint CLO DAC | | | |
| 5,175 % éch. 15/01/2034 | 3 400 | 3 729 | 0,46 |
| Carbone CLO Ltd. | | | |
| 6,817 % éch. 20/01/2031 | \$ 3 155 | 3 157 | 0,39 |
| Carlyle Euro CLO DAC | | | |
| 4,665 % éch. 15/01/2031 | € 2 182 | 2 386 | 0,29 |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | |
| 4,752 % éch. 15/11/2031 | 2 595 | 2 827 | 0,35 |
| Catamaran CLO Ltd. | | | |
| 6,774 % éch. 22/04/2030 | \$ 2 363 | 2 363 | 0,29 |
| CBAM Ltd. | | | |
| 6,684 % éch. 17/04/2031 | 476 | 475 | 0,06 |
| CIFC Funding Ltd. | | | |
| 6,844 % éch. 16/11/2030 | 2 000 | 2 002 | 0,25 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | |
| 6,520 % éch. 25/11/2034 | 252 | 248 | 0,03 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | |
| 5,077 % éch. 25/01/2032 | 6 | 6 | 0,00 |
| Fortress Investment Group LLC | | | |
| 7,187 % éch. 23/02/2039 | 7 200 | 7 024 | 0,87 |
| GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC | | | |
| 4,893 % éch. 20/01/2032 | € 2 500 | 2 734 | 0,34 |
| GoldenTree Loan Opportunities Ltd. | | | |
| 6,797 % éch. 20/07/2031 | \$ 2 650 | 2 652 | 0,33 |
| Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. | | | |
| 6,656 % éch. 15/09/2037 | 509 | 508 | 0,06 |
| Griffith Park CLO DAC | | | |
| 4,704 % éch. 21/11/2031 | € 2 987 | 3 248 | 0,40 |
| Harvest CLO DAC | | | |
| 4,566 % éch. 26/06/2030 | 1 985 | 2 169 | 0,27 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Jubilee CLO DAC | | | |
| 4,575 % éch. 15/04/2030 | € 3 778 | \$ 4 149 | 0,51 |
| Madison Park Euro Funding DAC | | | |
| 4,715 % éch. 15/01/2032 | 2 700 | 2 939 | 0,36 |
| Marble Point CLO Ltd. | | | |
| 6,837 % éch. 18/12/2030 | \$ 3 053 | 3 054 | 0,38 |
| Nassau Ltd. | | | |
| 6,805 % éch. 15/10/2029 | 517 | 517 | 0,06 |
| OCP Euro CLO DAC | | | |
| 5,873 % éch. 20/01/2033 | € 2 000 | 2 209 | 0,27 |
| Octagon Loan Funding Ltd. | | | |
| 6,809 % éch. 18/11/2031 | \$ 3 400 | 3 405 | 0,42 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | | |
| 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 2 346 | 2 551 | 0,31 |
| 4,695 % éch. 15/07/2031 | 1 973 | 2 153 | 0,27 |
| 5,602 % éch. 15/11/2032 | 3 138 | 3 466 | 0,43 |
| Saranac CLO Ltd. | | | |
| 7,233 % éch. 22/06/2030 | \$ 2 041 | 2 044 | 0,25 |
| SLM Student Loan Trust | | | |
| 5,746 % éch. 25/10/2029 | 132 | 132 | 0,02 |
| Tikehau CLO DAC | | | |
| 4,844 % éch. 04/08/2034 | € 2 300 | 2 511 | 0,31 |
| Toro European CLO DAC | | | |
| 4,812 % éch. 15/02/2034 | 3 200 | 3 487 | 0,43 |
| 4,908 % éch. 12/01/2032 | 2 500 | 2 740 | 0,34 |
| Venture CLO Ltd. | | | |
| 6,777 % éch. 20/01/2029 | \$ 1 574 | 1 574 | 0,19 |
| | <u>89 103</u> | <u>11,00</u> | |

ÉMISSIONS SOUVERAINES

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % éch. 01/01/2024 (b) | BRL 24 700 | 5 085 | 0,63 |
| 0,000 % éch. 01/07/2024 (b) | 71 800 | 14 066 | 1,74 |
| | | <u>19 151</u> | <u>2,37</u> |
| Total des Valeurs mobilières | \$ 1 099 774 | 135,80 | |

ACTIONS

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| PIMCO Funds: Global | | | |
| Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (c) | | | |
| | 3 382 522 | 34 231 | 4,23 |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c) | | | |
| | 3 121 | 31 | 0,00 |
| | | <u>34 262</u> | <u>4,23</u> |

FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c) | | | |
| | 484 660 | 48 331 | 5,97 |
| Total des Fonds d'investissement | \$ 82 593 | 10,20 | |

Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund (suite)

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|---------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 1 044 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | \$ (1 065) | \$ 1 044 | \$ 1 044 | 0,13 |
| | 5,330 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 58 700 | Billets du Trésor américain 1,500 % échéance 30/11/2028 | (59 874) | 58 700 | 58 700 | 7,25 |
| JPS | 5,490 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 100 | Billets du Trésor américain 4,125 % échéance 31/01/2025 | (102) | 100 | 100 | 0,01 |
| SAL | 5,480 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 40 900 | Billets du Trésor américain 0,375 % échéance 15/07/2024 | (41 782) | 40 900 | 40 906 | 5,05 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (102 823) | \$ 100 744 | \$ 100 750 | 12,44 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 91 | \$ (192) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 36 | (308) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 833 | 1 389 | 0,17 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 258 | 604 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 720 | (2 570) | (0,32) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 524 | (2 368) | (0,29) |
| | | | | \$ (3 445) | (0,42) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (3 445) | (0,42) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 % | 20/12/2024 | \$ 1 000 | \$ 2 | 0,00 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 % | 17/03/2024 | ¥ 5 680 000 | \$ 13 | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,380 | 18/06/2028 | 90 000 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | \$ 53 500 | (141) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 26 600 | (20) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,340 | 23/02/2030 | 2 900 | 3 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 1 100 | 3 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 1 200 | 4 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 40 700 | 23 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 14 800 | (115) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 1 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,233 | 13/09/2024 | 11 800 | (22) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 14/09/2024 | 12 600 | (22) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,715 | 13/09/2024 | 22 500 | (15) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,750 | 14/09/2024 | 12 600 | (7) | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 4,000 | 14/06/2024 | NZD 279 100 | 83 | 0,01 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 4,500 | 13/09/2024 | 8 800 | 70 | 0,01 |
| | | | | | \$ (142) | (0,02) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (140) | (0,02) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 % | 20/12/2026 | \$ 2 000 | \$ (94) | \$ 81 | \$ (13) | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 5 600 | (270) | 235 | (35) | (0,01) |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 1 900 | (108) | 109 | 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 2 300 | (205) | 193 | (12) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 4 200 | (195) | 169 | (26) | 0,00 |
| | | | | | \$ (872) | \$ 787 | \$ (85) | (0,01) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--------|
| BOA | 01/2024 | £ | 921 | \$ 1 170 | \$ 0 | \$ (4) | 0,00 | |
| | 01/2024 | NZD | 2 180 | 1 328 | 0 | (52) | (0,01) | |
| | 01/2024 | \$ | 2 762 | ¥ 407 621 | 131 | 0 | 0,02 | |
| BPS | 01/2024 | € | 680 | \$ 739 | 0 | (13) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 3 512 | 4 454 | 0 | (23) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 473 | ZAR 8 774 | 6 | 0 | 0,00 | |
| CBK | 02/2024 | | 2 | CNY 14 | 0 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 13 520 | BRL 65 831 | 32 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 560 | £ 1 228 | 5 | 0 | 0,00 | |
| GLM | 03/2024 | | 54 | ILS 197 | 1 | 0 | 0,00 | |
| | 04/2024 | BRL | 66 497 | \$ 13 520 | 0 | (56) | (0,01) | |
| | 01/2024 | | 93 000 | 18 356 | 0 | (789) | (0,10) | |
| JPM | 01/2024 | MXN | 1 134 | 65 | 0 | (2) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 19 464 | BRL 95 432 | 199 | (18) | 0,02 | |
| | 07/2024 | BRL | 71 800 | \$ 14 496 | 0 | (26) | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | | 68 032 | 14 094 | 89 | 0 | 0,01 | |
| | 03/2024 | CNH | 482 | 67 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 04/2024 | \$ | 14 094 | BRL 68 719 | 0 | (64) | (0,01) | |
| MYI | 01/2024 | ¥ | 65 200 | \$ 457 | 0 | (5) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ZAR | 104 098 | 5 447 | 0 | (239) | (0,03) | |
| | 01/2024 | \$ | 24 | € 21 | 0 | 0 | 0,00 | |
| RYL | 01/2024 | | 897 | £ 712 | 12 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 050 | ¥ 154 841 | 49 | 0 | 0,01 | |
| | 02/2024 | | 1 | CNY 10 | 0 | 0 | 0,00 | |
| UAG | 01/2024 | | 919 | NZD 1 479 | 17 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 1 736 | ¥ 254 637 | 71 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | € | 84 476 | \$ 92 921 | 0 | (417) | (0,05) | |
| | 01/2024 | £ | 19 078 | 24 144 | 0 | (178) | (0,02) | |
| | 01/2024 | \$ | 2 352 | ZAR 44 892 | 100 | 0 | 0,01 | |
| | | | | | \$ 712 | \$ (1 887) | \$ (1 175) | (0,15) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|------|
| BPS | 01/2024 | € | 913 | \$ 999 | \$ 0 | \$ (9) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 635 | € 582 | 8 | 0 | 0,00 | |
| CBK | 01/2024 | € | 96 | \$ 105 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 8 | € 7 | 0 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | € | 99 | \$ 108 | 0 | (1) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 15 718 | € 14 296 | 78 | 0 | 0,01 | |
| MYI | 01/2024 | | 15 642 | 14 232 | 82 | 0 | 0,01 | |
| UAG | 01/2024 | | 15 546 | 14 133 | 70 | 0 | 0,01 | |
| | | | | | \$ 238 | \$ (11) | \$ 227 | 0,03 |

Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 829 | £ 653 | \$ 4 | \$ 0 | \$ 4 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 2 087 | 1 643 | 8 | (1) | 7 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | £ 5 888 | \$ 7 500 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 32 | £ 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 114 | \$ 144 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 560 | £ 445 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | 9 185 | 7 263 | 74 | 0 | 74 | 0,01 |
| FAR | 01/2024 | £ 1 159 | \$ 1 468 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ 249 | £ 196 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 5 900 | \$ 7 515 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 170 | £ 134 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 9 551 | 7 590 | 125 | 0 | 125 | 0,01 |
| RYL | 01/2024 | £ 5 888 | \$ 7 499 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | \$ 9 710 | £ 7 677 | 77 | 0 | 77 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | 7 028 | 5 570 | 72 | 0 | 72 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 9 709 | 7 672 | 71 | 0 | 71 | 0,01 |
| | | | | \$ 440 | \$ (31) | \$ 409 | 0,05 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (624) (0,08)

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 3,000 % éch. 01/02/2054 | \$ 11 500 | \$ (10 185) | (1,26) |
| 3,000 % éch. 01/03/2054 | 13 000 | (11 528) | (1,42) |
| 3,500 % éch. 01/02/2054 | 31 000 | (28 472) | (3,52) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (50 185) | (6,20) |
| Total des Investissements | | \$ 1 228 717 | 151,72 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (418 872) | (51,72) |
| Actifs nets | | \$ 809 845 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à principal uniquement.
- (b) Titre à coupon zéro.
- (c) Affilié au Fonds.
- (d) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,26 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Citigroup, Inc. | 6,075 % | 25/01/2026 | 18/01/2022 | \$ 2 900 | \$ 2 884 | 0,36 |

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 271 704 \$ (31 décembre 2022 : 143 852 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 43 703 \$ (31 décembre 2022 : 4 050 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 5 856 \$ (31 décembre 2022 : 16 925 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 641 \$ (31 décembre 2022 : 5 301 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques | | Autres données significatives observables | Données significatives non observables | Juste valeur |
|---|--|---------------------|---|--|---------------------|
| | (Niveau 1) | (Niveau 2) | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 099 282 | | \$ 492 | \$ 1 099 774 |
| Fonds d'investissement | 34 262 | 48 331 | | 0 | 82 593 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 100 744 | | 0 | 100 744 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (500) | (3 709) | | 0 | (4 209) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (50 185) | | 0 | (50 185) |
| Totaux | \$ 33 762 | \$ 1 194 463 | | \$ 492 | \$ 1 228 717 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 234 805 | \$ 801 | \$ 1 235 606 |
| Fonds d'investissement | 37 618 | 48 013 | 0 | 85 631 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 956 | 0 | 956 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 1 960 | (9 079) | 0 | (7 119) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (76 949) | 0 | (76 949) |
| Totaux | \$ 39 578 | \$ 1 197 746 | \$ 801 | \$ 1 238 125 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| STR | 5,540 % | 02/01/2024 | 03/01/2024 | \$ (256 904) | \$ (256 904) | (31,72) |
| | 5,660 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | (268 565) | (268 691) | (33,18) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (525 595) | (64,90) |

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| MSC | 5,710 % | 19/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (24 470) | \$ (24 482) | (3,02) |
| | 5,740 | 19/12/2023 | 04/01/2024 | (19 788) | (19 797) | (2,45) |
| Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (44 279) | (5,47) |

⁽¹⁾ Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 21 \$ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ 66 | \$ 0 | \$ 66 | \$ (1 233) | \$ 1 360 | \$ 127 |
| BPS | (24) | 0 | (24) | (2 779) | 2 650 | (129) |
| BRC | (6) | 0 | (6) | 8 | 0 | 8 |
| CBK | (47) | 0 | (47) | 903 | (890) | 13 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (22) | 0 | (22) |
| DUB | 74 | 0 | 74 | S/O | S/O | S/O |
| FAR | (9) | 0 | (9) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | (636) | 501 | (135) | (802) | 751 | (51) |
| JPM | 24 | 0 | 24 | 97 | (190) | (93) |
| MBC | (173) | 30 | (143) | 1 204 | (980) | 224 |
| MYC | (37) | 260 | 223 | (1 239) | 510 | (729) |
| MYI | 268 | (390) | (122) | (103) | 30 | (73) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (1) | 0 | (1) |
| SAL | S/O | S/O | S/O | (4) | 0 | (4) |
| RYL | 10 | 0 | 10 | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 77 | (110) | (33) | 277 | (230) | 47 |
| SSB | 72 | 0 | 72 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 71 | 0 | 71 | 5 | (10) | (5) |
| UAG | (354) | 850 | 496 | 215 | 0 | 215 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 84,32 | 70,91 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 51,48 | 43,49 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 0,78 |
| Fonds d'investissement | 10,20 | 7,98 |
| Contrats de mise en pension | 12,44 | 0,09 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,42) | 0,21 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,02) | (0,55) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,08) | (0,32) |
| Titres vendus à découvert | (6,20) | (7,17) |
| Contrats de prise en pension | (64,90) | (13,50) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (5,47) | (0,38) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 26,24 | 28,04 |
| Agences du gouvernement américain | 34,15 | 22,99 |
| Obligations du Trésor américain | 56,55 | 47,28 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 5,49 | 6,37 |
| Titres adossés à des actifs | 11,00 | 9,23 |
| Émissions souveraines | 2,37 | S/O |
| Instruments à court terme | S/O | 1,27 |
| Fonds d'investissement | 10,20 | 7,98 |
| Contrats de mise en pension | 12,44 | 0,09 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,42) | 0,21 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | S/O | (0,07) |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,02) | (0,48) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,03 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | (0,19) |
| Options sur titres | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | (0,01) | (0,07) |
| Contrats de change à terme | (0,15) | (0,27) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,08 | 0,18 |
| Titres vendus à découvert | (6,20) | (7,17) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (51,72) | (15,42) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | VALEURS MOBILIÈRES | | | | VALEURS MOBILIÈRES | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | |
| Delos Aircraft DAC 7,348 % éch. 31/10/2027 | \$ 240 | \$ 241 | 0,02 | Bank of America N.A. 5,526 % éch. 18/08/2026 | \$ 1 000 | \$ 1 019 | 0,11 | Danske Bank A/S 6,259 % éch. 22/09/2026 | \$ 3 000 | \$ 3 054 | 0,31 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | BANQUE ET FINANCE | | | | BANQUE ET FINANCE | | | |
| Abanca Corp. Bancaria S.A. 0,500 % éch. 08/09/2027 | € 400 | 404 | 0,04 | Bank of Nova Scotia 0,250 % éch. 01/11/2028 | € 400 | 384 | 0,04 | Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 03/09/2026 | € 300 | 318 | 0,03 |
| ABN AMRO Bank NV 3,625 % éch. 10/01/2026 | 700 | 780 | 0,08 | Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 4,875 % éch. 25/09/2025 | £ 3 000 | 3 825 | 0,39 | 1,447 % éch. 01/04/2025 (f) | \$ 1 600 | 1 581 | 0,16 |
| 6,339 % éch. 18/09/2027 | \$ 2 500 | 2 556 | 0,26 | Barclays PLC 2,885 % éch. 31/01/2027 | € 300 | 326 | 0,03 | 2,129 % éch. 24/11/2026 (f) | 500 | 469 | 0,05 |
| Aegon Bank NV 0,625 % éch. 21/06/2024 | € 3 300 | 3 587 | 0,37 | 3,375 % éch. 02/04/2025 | 400 | 441 | 0,05 | 6,720 % éch. 18/01/2029 | 2 000 | 2 096 | 0,22 |
| AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % éch. 14/08/2024 | \$ 700 | 687 | 0,07 | 7,285 % éch. 13/09/2027 | \$ 6 500 | 6 524 | 0,67 | 6,819 % éch. 20/11/2029 | 600 | 632 | 0,07 |
| AIB Group PLC 3,625 % éch. 04/07/2026 | € 300 | 332 | 0,03 | BGC Group, Inc. 8,000 % éch. 25/05/2028 | 400 | 418 | 0,04 | Deutsche Boerse AG 3,875 % éch. 28/09/2026 | € 2 000 | 2 258 | 0,23 |
| Aircastle Ltd. 5,250 % éch. 11/08/2025 | \$ 1 805 | 1 780 | 0,18 | Blackstone Private Credit Fund 2,350 % éch. 22/11/2024 | 900 | 871 | 0,09 | Digital Euro Finco LLC 2,500 % éch. 16/01/2026 | 300 | 323 | 0,03 |
| 6,500 % éch. 18/07/2028 | 500 | 510 | 0,05 | 4,700 % éch. 24/03/2025 | 700 | 689 | 0,07 | EPR Properties 4,500 % éch. 01/06/2027 | \$ 1 500 | 1 416 | 0,15 |
| Ally Financial, Inc. 5,800 % éch. 01/05/2025 | 2 000 | 2 003 | 0,21 | BNP Paribas S.A. 2,125 % éch. 23/01/2027 | € 300 | 322 | 0,03 | EQT AB 2,375 % éch. 06/04/2028 | € 400 | 418 | 0,04 |
| 6,848 % éch. 03/01/2030 | 500 | 514 | 0,05 | 2,219 % éch. 09/06/2026 | \$ 1 500 | 1 433 | 0,15 | Equinix, Inc. 0,250 % éch. 15/03/2027 | 400 | 402 | 0,04 |
| AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % éch. 06/02/2027 | € 1 400 | 1 591 | 0,16 | 3,375 % éch. 09/01/2025 | 4 883 | 4 784 | 0,49 | Equitable Financial Life Global Funding 5,500 % éch. 02/12/2025 | \$ 3 200 | 3 203 | 0,33 |
| American Honda Finance Corp. 5,000 % éch. 23/05/2025 | \$ 1 800 | 1 806 | 0,19 | 3,800 % éch. 10/01/2024 | 500 | 500 | 0,05 | Union européenne 2,000 % éch. 04/10/2027 | € 12 200 | 13 279 | 1,37 |
| American Tower Corp. 1,450 % éch. 15/09/2026 | 4 000 | 3 647 | 0,38 | BPCE S.A. 0,500 % éch. 15/09/2027 | € 400 | 408 | 0,04 | Extra Space Storage LP 5,700 % éch. 01/04/2028 | \$ 400 | 410 | 0,04 |
| 2,400 % éch. 15/03/2025 | 800 | 773 | 0,08 | 1,652 % éch. 06/10/2026 | \$ 300 | 279 | 0,03 | F&G Global Funding 2,300 % éch. 11/04/2027 | 1 000 | 900 | 0,09 |
| 3,650 % éch. 15/03/2027 | 900 | 866 | 0,09 | 3,625 % éch. 17/04/2026 | € 600 | 669 | 0,07 | Fastighets AB Balder 1,125 % éch. 29/01/2027 | € 1 500 | 1 421 | 0,15 |
| 5,250 % éch. 15/07/2028 | 1 000 | 1 017 | 0,10 | 5,975 % éch. 18/01/2026 | \$ 2 800 | 2 824 | 0,29 | First American Financial Corp. 4,600 % éch. 15/11/2024 | \$ 200 | 198 | 0,02 |
| 5,800 % éch. 15/11/2028 | 4 800 | 4 991 | 0,51 | Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % éch. 15/11/2027 | 600 | 537 | 0,06 | Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % éch. 19/07/2024 | € 100 | 109 | 0,01 |
| Ares Capital Corp. 2,875 % éch. 15/06/2027 | 800 | 732 | 0,08 | 7,800 % éch. 15/03/2028 | 300 | 304 | 0,03 | 2,386 % éch. 17/02/2026 | 300 | 323 | 0,03 |
| 7,000 % éch. 15/01/2027 | 2 000 | 2 058 | 0,21 | Caixa Bank S.A. 4,625 % éch. 16/05/2027 | € 300 | 338 | 0,04 | 3,021 % éch. 06/03/2024 | 800 | 882 | 0,09 |
| Ares Management Corp. 6,375 % éch. 10/11/2028 | 2 400 | 2 518 | 0,26 | Cantor Fitzgerald LP 4,500 % éch. 14/04/2027 | \$ 600 | 576 | 0,06 | 3,250 % éch. 15/09/2025 | 200 | 218 | 0,02 |
| ASB Bank Ltd. 4,500 % éch. 16/03/2027 | € 300 | 342 | 0,04 | 7,200 % éch. 12/12/2028 | 500 | 513 | 0,05 | 4,535 % éch. 06/03/2025 | £ 600 | 754 | 0,08 |
| Banque de développement asiatique 6,125 % éch. 15/08/2025 | £ 4 000 | 5 219 | 0,54 | Charles Schwab Corp. 0,750 % éch. 18/03/2024 | 2 600 | 2 574 | 0,27 | 4,542 % éch. 01/08/2026 | \$ 500 | 484 | 0,05 |
| Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc. 6,125 % éch. 15/09/2028 | \$ 500 | 525 | 0,05 | 5,916 % éch. 13/05/2026 | 200 | 197 | 0,02 | 4,675 % éch. 01/12/2024 | € 1 100 | 1 218 | 0,13 |
| Athene Global Funding 2,500 % éch. 24/03/2028 | 2 053 | 1 825 | 0,19 | 5,924 % éch. 18/03/2024 | 1 500 | 1 500 | 0,15 | 4,950 % éch. 28/05/2027 | \$ 500 | 488 | 0,05 |
| 6,108 % éch. 24/05/2024 | 2 500 | 2 498 | 0,26 | Citigroup, Inc. 2,014 % éch. 25/01/2026 (f) | 2 000 | 1 923 | 0,20 | Freedom Mortgage Corp. 12,000 % éch. 01/10/2028 | 300 | 328 | 0,03 |
| Aviation Capital Group LLC 4,375 % éch. 30/01/2024 | 800 | 799 | 0,08 | 3,290 % éch. 17/03/2026 (f) | 3 200 | 3 117 | 0,32 | FS KKR Capital Corp. 1,650 % éch. 12/10/2024 | 800 | 772 | 0,08 |
| 5,500 % éch. 15/12/2024 | 700 | 697 | 0,07 | Clydesdale Bank PLC 5,820 % éch. 22/09/2028 | £ 1 100 | 1 402 | 0,14 | 2,625 % éch. 15/01/2027 | 400 | 359 | 0,04 |
| Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027 | 1 600 | 1 419 | 0,15 | Commerzbank AG 4,625 % éch. 21/03/2028 | € 300 | 339 | 0,04 | 7,875 % éch. 15/01/2029 | 400 | 424 | 0,04 |
| 3,950 % éch. 01/07/2024 | 1 400 | 1 382 | 0,14 | 5,250 % éch. 25/03/2029 | 400 | 465 | 0,05 | GA Global Funding Trust 1,000 % éch. 08/04/2024 | 1 400 | 1 380 | 0,14 |
| 6,375 % éch. 04/05/2028 | 500 | 510 | 0,05 | Commonwealth Bank of Australia 3,768 % éch. 31/08/2027 | 2 000 | 2 273 | 0,23 | Gaci First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030 | 1 200 | 1 201 | 0,12 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % éch. 09/01/2026 | € 900 | 946 | 0,10 | 5,071 % éch. 14/09/2028 | \$ 1 350 | 1 381 | 0,14 | General Motors Financial Co., Inc. 0,600 % éch. 20/05/2027 | € 400 | 404 | 0,04 |
| 2,625 % éch. 28/04/2025 | 500 | 539 | 0,06 | Consumers Securitization Funding LLC 5,550 % éch. 01/03/2028 | 1 500 | 1 507 | 0,16 | 5,150 % éch. 15/08/2026 | £ 1 400 | 1 795 | 0,18 |
| 3,625 % éch. 24/09/2024 | 4 100 | 4 499 | 0,46 | Cooperative Rabobank UA 2,625 % éch. 22/07/2024 | 300 | 295 | 0,03 | Goldman Sachs Group, Inc. 1,948 % éch. 21/10/2027 | \$ 4 300 | 3 935 | 0,40 |
| Banco BPM SpA 3,875 % éch. 18/09/2026 | 2 600 | 2 926 | 0,30 | Corebridge Financial, Inc. 3,650 % éch. 05/04/2027 | 1 800 | 1 733 | 0,18 | 3,272 % éch. 29/09/2025 | 2 700 | 2 655 | 0,27 |
| Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % éch. 10/01/2025 | \$ 500 | 492 | 0,05 | CPI Property Group S.A. 2,750 % éch. 12/05/2026 | € 1 200 | 1 110 | 0,11 | 3,850 % éch. 08/07/2024 | 2 000 | 1 983 | 0,20 |
| Banco de Sabadell S.A. 5,125 % éch. 10/11/2028 | € 600 | 698 | 0,07 | Credit Acceptance Corp. 9,250 % éch. 15/12/2028 | \$ 500 | 534 | 0,06 | 6,079 % éch. 24/01/2025 | 1 600 | 1 599 | 0,16 |
| Banco Santander Chile 2,700 % éch. 10/01/2025 | \$ 500 | 487 | 0,05 | Crédit Agricole S.A. 0,500 % éch. 24/06/2024 | € 2 300 | 2 500 | 0,26 | 6,484 % éch. 24/10/2029 | 2 000 | 2 124 | 0,22 |
| Banco Santander S.A. 6,527 % éch. 07/11/2027 | 2 400 | 2 483 | 0,26 | 6,316 % éch. 03/10/2029 | \$ 250 | 262 | 0,03 | Golub Capital BDC, Inc. 7,050 % éch. 05/12/2028 | 400 | 420 | 0,04 |
| 6,607 % éch. 07/11/2028 | 1 000 | 1 066 | 0,11 | Credit Suisse AG 0,250 % éch. 05/01/2026 | € 300 | 311 | 0,03 | Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % éch. 15/03/2028 | 3 200 | 2 981 | 0,31 |
| Bank of America Corp. 2,015 % éch. 13/02/2026 | 1 100 | 1 057 | 0,11 | 4,750 % éch. 09/08/2024 | \$ 300 | 298 | 0,03 | Groupe Bruxelles Lambert NV 1,875 % éch. 19/06/2025 | € 1 700 | 1 837 | 0,19 |
| 2,375 % éch. 19/06/2024 | € 10 200 | 11 185 | 1,15 | 7,950 % éch. 09/01/2025 | 3 000 | 3 068 | 0,32 | Hamburg Commercial Bank AG 4,875 % éch. 17/03/2025 | 1 700 | 1 885 | 0,19 |
| 5,080 % éch. 20/01/2027 | \$ 2 300 | 2 296 | 0,24 | Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % éch. 19/11/2025 | € 1 600 | 1 669 | 0,17 | 6,250 % éch. 18/11/2024 | 2 000 | 2 216 | 0,23 |
| 5,933 % éch. 15/09/2027 | 1 500 | 1 531 | 0,16 | Crown Castle, Inc. 3,650 % éch. 01/09/2027 | \$ 200 | 190 | 0,02 | HSBC Holdings PLC 2,099 % éch. 04/06/2026 | \$ 1 000 | 952 | 0,10 |
| | | | | 3,700 % éch. 15/06/2026 | 600 | 579 | 0,06 | 3,019 % éch. 15/06/2027 | € 1 300 | 1 419 | 0,15 |
| | | | | 4,800 % éch. 01/09/2028 | 2 163 | 2 136 | 0,22 | 4,583 % éch. 19/06/2029 | \$ 3 000 | 2 911 | 0,30 |
| | | | | CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025 | € 100 | 104 | 0,01 | Hudson Pacific Properties LP 5,950 % éch. 15/02/2028 | 900 | 797 | 0,08 |
| | | | | 0,625 % éch. 27/09/2026 | 400 | 398 | 0,04 | ING Belgium S.A. 3,375 % éch. 31/05/2027 | € 2 300 | 2 592 | 0,27 |
| | | | | 0,750 % éch. 18/02/2027 | 1 500 | 1 477 | 0,15 | ING Groep NV 2,125 % éch. 23/05/2026 | 300 | 324 | 0,03 |
| | | | | 0,875 % éch. 20/01/2026 | 2 100 | 2 153 | 0,22 | | | | |
| | | | | DAE Sukuk Dfc Ltd. 3,750 % éch. 15/02/2026 | \$ 700 | 674 | 0,07 | | | | |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Intesa Sanpaolo SpA | € 300 | \$ 312 | 0,03 | Nissan Motor Acceptance Co. LLC | \$ 1 400 | \$ 1 351 | 0,14 | Synchrony Financial | \$ 600 | \$ 598 | 0,06 |
| 0,625 % éch. 24/02/2026 | | | | 1,125 % éch. 16/09/2024 | | | | 4,375 % éch. 19/03/2024 | | | |
| 5,017 % éch. 26/06/2024 | \$ 2 200 | 2 178 | 0,22 | Nomura Holdings, Inc. | 500 | 457 | 0,05 | Synovus Bank | 500 | 481 | 0,05 |
| 7,000 % éch. 21/11/2025 | 600 | 615 | 0,06 | 1,653 % éch. 14/07/2026 | | | | 5,625 % éch. 15/02/2028 | | | |
| Jackson National Life Global Funding | 1 000 | 959 | 0,10 | 1,851 % éch. 16/07/2025 | 500 | 474 | 0,05 | Toronto-Dominion Bank | € 5 000 | 5 638 | 0,58 |
| 1,750 % éch. 12/01/2025 | | | | 2,648 % éch. 16/01/2025 | 200 | 194 | 0,02 | 3,765 % éch. 08/09/2026 | \$ 410 | 410 | 0,04 |
| Jefferies Financial Group, Inc. | 700 | 718 | 0,07 | 5,386 % éch. 06/07/2027 | 2 800 | 2 813 | 0,29 | 5,768 % éch. 10/09/2024 | | | |
| 5,875 % éch. 21/07/2028 | | | | NongHyup Bank | 2 500 | 2 439 | 0,25 | Toyota Motor Credit Corp. | 2 250 | 2 252 | 0,23 |
| Jones Lang LaSalle, Inc. | 1 000 | 1 060 | 0,11 | 0,875 % éch. 28/07/2024 | | | | 5,900 % éch. 22/08/2024 | | | |
| 6,875 % éch. 01/12/2028 | | | | Nordea Bank Abp | € 900 | 935 | 0,10 | TP ICAP Finance PLC | € 600 | 641 | 0,07 |
| JPMorgan Chase & Co. | € 300 | 315 | 0,03 | 1,125 % éch. 16/02/2027 | | | | 2,625 % éch. 18/11/2028 | | | |
| 1,090 % éch. 11/03/2027 | | | | Nova Kreditna Banka Maribor d.d. | 600 | 660 | 0,07 | Truist Bank | \$ 3 000 | 2 915 | 0,30 |
| 2,083 % éch. 22/04/2026 | \$ 2 700 | 2 587 | 0,27 | 1,875 % éch. 27/01/2025 | | | | 2,150 % éch. 06/12/2024 | | | |
| 2,882 % éch. 01/02/2028 | 2 875 | 2 779 | 0,29 | Nykredit Realkredit A/S | 3 000 | 3 104 | 0,32 | U.S. Bancorp | 1 000 | 985 | 0,10 |
| 4,452 % éch. 05/12/2029 | 3 271 | 3 208 | 0,33 | 1,375 % éch. 12/07/2027 | | | | 4,653 % éch. 01/02/2029 | | | |
| 4,851 % éch. 25/07/2028 | 2 400 | 2 402 | 0,25 | Pacific Life Global Funding | \$ 1 700 | 1 572 | 0,16 | UBS AG | | | |
| 5,299 % éch. 24/07/2029 | 5 200 | 5 280 | 0,54 | 1,375 % éch. 14/04/2026 | | | | 5,125 % éch. 15/05/2024 | 300 | 298 | 0,03 |
| 6,018 % éch. 10/12/2025 | 1 600 | 1 598 | 0,16 | Principal Life Global Funding | 500 | 500 | 0,05 | (e) | | | |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | 1 750 | 1 766 | 0,18 | 5,787 % éch. 23/08/2024 | | | | UBS Group AG | 2 300 | 2 079 | 0,21 |
| 5,110 % éch. 08/12/2026 | | | | Protective Life Global Funding | 1 000 | 943 | 0,10 | 1,494 % éch. 10/08/2027 | | | |
| KBC Group NV | € 300 | 335 | 0,03 | 1,170 % éch. 15/07/2025 | 1 000 | 962 | 0,10 | 3,869 % éch. 12/01/2029 | 2 350 | 2 217 | 0,23 |
| 4,500 % éch. 06/06/2026 | | | | 1,646 % éch. 13/01/2025 | 1 000 | 962 | 0,10 | 4,488 % éch. 12/05/2026 | 3 500 | 3 449 | 0,35 |
| 5,796 % éch. 19/01/2029 | \$ 1 420 | 1 445 | 0,15 | 4,714 % éch. 06/07/2027 | 3 300 | 3 284 | 0,34 | 4,550 % éch. 17/04/2026 | 1 600 | 1 580 | 0,16 |
| LeasePlan Corp. NV | 1 500 | 1 467 | 0,15 | QNB Finance Ltd. | 300 | 278 | 0,03 | 6,246 % éch. 22/09/2029 | 2 000 | 2 088 | 0,22 |
| 2,875 % éch. 24/10/2024 | | | | 1,375 % éch. 26/01/2026 | | | | 6,373 % éch. 15/07/2026 | 3 000 | 3 036 | 0,31 |
| Lloyds Banking Group PLC | € 300 | 345 | 0,04 | Realty Income Corp. | 1 000 | 1 008 | 0,10 | 6,442 % éch. 11/08/2028 | 2 235 | 2 322 | 0,24 |
| 4,500 % éch. 11/01/2029 | | | | 4,700 % éch. 15/12/2028 | | | | UniCredit SpA | € 300 | 320 | 0,03 |
| 5,985 % éch. 07/08/2027 | \$ 1 900 | 1 935 | 0,20 | Retail Opportunity Investments Partnership LP | 400 | 421 | 0,04 | 2,200 % éch. 22/07/2027 | | | |
| Logicor Financing SARL | € 400 | 432 | 0,04 | 6,750 % éch. 15/10/2028 | | | | 5,850 % éch. 15/11/2027 | 2 000 | 2 342 | 0,24 |
| 0,750 % éch. 15/07/2024 | 800 | 814 | 0,08 | RGA Global Funding | 1 000 | 1 038 | 0,11 | VICI Properties LP | \$ 800 | 770 | 0,08 |
| 1,625 % éch. 15/07/2027 | 300 | 321 | 0,03 | 6,000 % éch. 21/11/2028 | | | | 4,250 % éch. 01/12/2026 | 400 | 387 | 0,04 |
| 2,250 % éch. 13/05/2025 | | | | Royal Bank of Canada | € 2 600 | 2 966 | 0,31 | 4,500 % éch. 01/09/2026 | 700 | 698 | 0,07 |
| Lseg Netherlands BV | 1 000 | 1 059 | 0,11 | 4,125 % éch. 05/07/2028 | € 2 600 | 3 314 | 0,34 | 5,625 % éch. 01/05/2024 | | | |
| 0,000 % éch. 06/04/2025 | 2 400 | 2 721 | 0,28 | 5,850 % éch. 18/03/2027 | € 2 600 | 3 314 | 0,34 | Virgin Money UK PLC | € 1 200 | 1 325 | 0,14 |
| (b) | | | | Sagax AB | € 2 200 | 2 366 | 0,24 | 4,625 % éch. 29/10/2028 | | | |
| 4,125 % éch. 29/09/2026 | | | | 2,250 % éch. 13/03/2025 | | | | Volkswagen Financial Services NV | \$ 3 000 | 3 879 | 0,40 |
| LSEGA Financing PLC | \$ 1 600 | 1 476 | 0,15 | Sagax Euro MTN NL BV | 1 500 | 1 573 | 0,16 | 5,500 % éch. 07/12/2026 | 500 | 667 | 0,07 |
| 1,375 % éch. 06/04/2026 | | | | 1,625 % éch. 24/02/2026 | | | | 6,500 % éch. 18/09/2027 | | | |
| MassMutual Global Funding | 1 000 | 998 | 0,10 | Santander Holdings USA, Inc. | \$ 4 000 | 4 136 | 0,43 | Vonovia SE | € 1 500 | 1 483 | 0,15 |
| 4,500 % éch. 10/04/2026 | 6 000 | 6 037 | 0,62 | 6,499 % éch. 09/03/2029 | | | | 0,375 % éch. 16/06/2027 | | | |
| 6,344 % éch. 10/07/2026 | | | | Santander UK Group Holdings PLC | 1 200 | 1 120 | 0,12 | Vornado Realty LP | \$ 275 | 248 | 0,03 |
| Metropolitan Life Global Funding | € 2 100 | 2 298 | 0,24 | 1,532 % éch. 21/08/2026 | 2 400 | 2 446 | 0,25 | 2,150 % éch. 01/06/2026 | | | |
| 0,375 % éch. 09/04/2024 | 300 | 342 | 0,04 | 6,833 % éch. 21/11/2026 | | | | Wells Fargo & Co. | € 400 | 411 | 0,04 |
| 4,000 % éch. 05/04/2028 | | | | SBA Tower Trust | 1 900 | 1 698 | 0,17 | 1,000 % éch. 02/02/2027 | \$ 2 700 | 2 565 | 0,26 |
| Mitsubishi HC Capital, Inc. | \$ 1 200 | 1 201 | 0,12 | 1,631 % éch. 15/05/2051 | | | | 3,000 % éch. 23/10/2026 | 1 600 | 1 584 | 0,16 |
| 5,080 % éch. 15/09/2027 | | | | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | 1 400 | 84 | 0,01 | 4,540 % éch. 15/08/2026 | 8 400 | 8 582 | 0,88 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | 3 000 | 2 759 | 0,28 | 5,125 % éch. 29/10/2022 ^ | 500 | 30 | 0,00 | 5,574 % éch. 25/07/2029 | | | |
| 3,195 % éch. 18/07/2029 | € 2 300 | 2 525 | 0,26 | 5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (e) | | | | Wells Fargo Bank N.A. | 200 | 202 | 0,02 |
| 3,273 % éch. 19/09/2025 | | | | SELP Finance SARL | € 300 | 332 | 0,03 | 5,550 % éch. 01/08/2025 | | | |
| Mizuho Financial Group, Inc. | € 2 100 | 2 780 | 0,29 | 3,750 % éch. 10/08/2027 | | | | Westpac Banking Corp. | € 300 | 335 | 0,03 |
| 5,628 % éch. 13/06/2028 | | | | Shinhan Bank Co. Ltd. | 1 100 | 1 181 | 0,12 | 3,703 % éch. 16/01/2026 | | | |
| Morgan Stanley | € 2 100 | 2 410 | 0,25 | 0,250 % éch. 16/10/2024 | | | | Weyerhaeuser Co. | \$ 2 200 | 2 191 | 0,23 |
| 4,656 % éch. 02/03/2029 | \$ 500 | 510 | 0,05 | 1,183 % éch. 29/09/2025 | AUD 800 | 513 | 0,05 | 4,750 % éch. 15/05/2026 | | | |
| 5,449 % éch. 20/07/2029 | 455 | 454 | 0,05 | Sirius Real Estate Ltd. | € 1 200 | 1 199 | 0,12 | Yorkshire Building Society | € 400 | 387 | 0,04 |
| 6,007 % éch. 24/01/2025 | 100 | 102 | 0,01 | 1,125 % éch. 22/06/2026 | | | | 0,500 % éch. 01/07/2028 | | | |
| 6,138 % éch. 16/10/2026 | | | | SLM Corp. | \$ 600 | 560 | 0,06 | ZF Finance GmbH | 1 500 | 1 581 | 0,16 |
| Morgan Stanley Bank N.A. | 3 000 | 2 999 | 0,31 | 3,125 % éch. 02/11/2026 | | | | 2,750 % éch. 25/05/2027 | | | |
| 4,754 % éch. 21/04/2026 | 2 000 | 2 057 | 0,21 | SMBC Aviation Capital Finance DAC | 3 330 | 3 308 | 0,34 | | | | |
| 5,882 % éch. 30/10/2026 | | | | 3,550 % éch. 15/04/2024 | | | | INDUSTRIE | | | |
| Mutual of Omaha Cos. Global Funding | 1 000 | 1 022 | 0,11 | Société Générale S.A. | € 400 | 407 | 0,04 | ABB Finance BV | 2 100 | 2 301 | 0,24 |
| 5,450 % éch. 12/12/2028 | | | | 0,750 % éch. 25/01/2027 | \$ 5 500 | 5 066 | 0,52 | 0,625 % éch. 31/03/2024 | | | |
| National Bank of Canada | 1 500 | 1 500 | 0,15 | 1,488 % éch. 14/12/2026 | | | | Air Canada Pass-Through Trust | \$ 638 | 588 | 0,06 |
| 5,880 % éch. 06/08/2024 | | | | Standard Chartered PLC | 1 000 | 999 | 0,10 | 3,750 % éch. 15/06/2029 | | | |
| Nationale-Nederlanden Bank NV | € 2 000 | 2 256 | 0,23 | 0,991 % éch. 12/01/2025 | 500 | 497 | 0,05 | Alaska Airlines Pass-Through Trust | 459 | 447 | 0,05 |
| 3,625 % éch. 16/10/2026 | 400 | 456 | 0,05 | 1,214 % éch. 23/03/2025 | 300 | 305 | 0,03 | 4,800 % éch. 15/02/2029 | | | |
| Nationwide Building Society | \$ 4 000 | 4 143 | 0,43 | 6,170 % éch. 09/01/2027 | | | | Altice France S.A. | 400 | 312 | 0,03 |
| 4,500 % éch. 01/11/2026 | | | | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | € 5 000 | 5 219 | 0,54 | 5,125 % éch. 15/07/2029 | | | |
| 6,557 % éch. 18/10/2027 | 550 | 550 | 0,06 | 0,010 % éch. 10/09/2025 | | | | American Airlines Pass-Through Trust | 467 | 436 | 0,04 |
| Nationwide Mutual Insurance Co. | 550 | 550 | 0,06 | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | \$ 3 000 | 2 734 | 0,28 | 3,575 % éch. 15/07/2029 | 1 628 | 1 525 | 0,16 |
| 7,936 % éch. 15/12/2024 | | | | 5,716 % éch. 14/09/2028 | 600 | 622 | 0,06 | 3,600 % éch. 22/03/2029 | | | |
| NatWest Group PLC | 2 000 | 2 018 | 0,21 | Svenska Handelsbanken AB | 300 | 273 | 0,03 | American Medical Systems Europe BV | € 3 000 | 3 204 | 0,33 |
| 5,847 % éch. 02/03/2027 | 1 200 | 1 243 | 0,13 | 1,418 % éch. 11/06/2027 | | | | 0,750 % éch. 08/03/2025 | 300 | 311 | 0,03 |
| 7,472 % éch. 10/11/2026 | | | | Synchrony Bank | 1 400 | 1 380 | 0,14 | 1,375 % éch. 08/03/2028 | | | |
| NatWest Markets PLC | € 1 300 | 1 419 | 0,15 | 5,400 % éch. 22/08/2025 | | | | Amgen, Inc. | \$ 1 000 | 1 024 | 0,11 |
| 1,000 % éch. 28/05/2024 | | | | | | | | 5,150 % éch. 02/03/2028 | 2 500 | 2 507 | 0,26 |
| NE Property BV | 1 500 | 1 517 | 0,16 | | | | | 5,250 % éch. 02/03/2025 | | | |
| 1,875 % éch. 09/10/2026 | | | | | | | | | | | |

426 303 43,82

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------|
| Arcadis NV | | | | 4,900 % éch. 01/10/2026 | \$ 500 | \$ 501 | 0,05 | John Lewis PLC | | | | |
| 4,875 % éch. 28/02/2028 | € 2 400 | \$ 2 750 | 0,28 | Delta Air Lines, Inc. | | | | 6,125 % éch. 21/01/2025 | £ 200 | \$ 254 | 0,03 | |
| Asahi Group Holdings Ltd. | | | | 2,900 % éch. 28/10/2024 | 2 100 | 2 046 | 0,21 | Kenvue, Inc. | | | | |
| 0,010 % éch. 19/04/2024 | 1 200 | 1 310 | 0,13 | Devon Energy Corp. | | | | 5,500 % éch. 22/03/2025 | \$ 2 600 | 2 623 | 0,27 | |
| 0,155 % éch. 23/10/2024 | 500 | 536 | 0,06 | eBay, Inc. | | | | 5,125 % éch. 23/11/2026 | £ 2 600 | 3 383 | 0,35 | |
| Ashtead Capital, Inc. | | | | 5,900 % éch. 22/11/2025 | 4 000 | 4 067 | 0,42 | Kinder Morgan Energy Partners LP | | | | |
| 1,500 % éch. 12/08/2026 | \$ 400 | 363 | 0,04 | Enbridge, Inc. | | | | 4,250 % éch. 01/09/2024 | \$ 600 | 595 | 0,06 | |
| Assa Abloy AB | | | | 5,900 % éch. 15/11/2026 | 4 300 | 4 416 | 0,45 | Kraft Heinz Foods Co. | | | | |
| 3,750 % éch. 13/09/2026 | € 1 600 | 1 801 | 0,19 | Energy Transfer LP | | | | 2,250 % éch. 28/05/2028 | € 300 | 321 | 0,03 | |
| Astrazeneca Finance LLC | | | | 5,550 % éch. 15/02/2028 | 4 000 | 4 083 | 0,42 | L3Harris Technologies, Inc. | | | | |
| 4,875 % éch. 03/03/2028 | \$ 600 | 612 | 0,06 | 6,050 % éch. 01/12/2026 | 1 000 | 1 029 | 0,11 | 5,400 % éch. 15/01/2027 | \$ 2 900 | 2 962 | 0,30 | |
| Aurizon Network Pty. Ltd. | | | | Eni SpA | | | | Las Vegas Sands Corp. | | | | |
| 3,125 % éch. 01/06/2026 | € 600 | 657 | 0,07 | 4,750 % éch. 12/09/2028 | 1 000 | 1 001 | 0,10 | 3,500 % éch. 18/08/2026 | 1 700 | 1 622 | 0,17 | |
| BAE Systems Holdings, Inc. | | | | Entergy Louisiana LLC | | | | Lenovo Group Ltd. | | | | |
| 3,850 % éch. 15/12/2025 | \$ 1 100 | 1 077 | 0,11 | 0,950 % éch. 01/10/2024 | 1 400 | 1 355 | 0,14 | 5,875 % éch. 24/04/2025 | 600 | 603 | 0,06 | |
| Baxter International, Inc. | | | | EQM Midstream Partners LP | | | | Marriott International, Inc. | | | | |
| 5,853 % éch. 29/11/2024 | 2 389 | 2 384 | 0,25 | 4,000 % éch. 01/08/2024 | 75 | 74 | 0,01 | 5,550 % éch. 15/10/2028 | 5 500 | 5 676 | 0,58 | |
| Bayer AG | | | | Equifax, Inc. | | | | Marvell Technology, Inc. | | | | |
| 0,050 % éch. 12/01/2025 | € 500 | 531 | 0,05 | 5,100 % éch. 01/06/2028 | 600 | 605 | 0,06 | 2,450 % éch. 15/04/2028 | 1 800 | 1 625 | 0,17 | |
| Bayer U.S. Finance LLC | | | | Expedia Group, Inc. | | | | Mattel, Inc. | | | | |
| 6,125 % éch. 21/11/2026 | \$ 1 800 | 1 831 | 0,19 | 6,250 % éch. 01/05/2025 | 2 015 | 2 036 | 0,21 | 3,375 % éch. 01/04/2026 | 900 | 857 | 0,09 | |
| Becton Dickinson Euro Finance SARL | | | | Flex Ltd. | | | | McDonald's Corp. | | | | |
| 0,334 % éch. 13/08/2028 | € 400 | 390 | 0,04 | 6,000 % éch. 15/01/2028 | 1 700 | 1 757 | 0,18 | 3,625 % éch. 28/11/2027 | € 1 000 | 1 129 | 0,12 | |
| BHP Billiton Finance Ltd. | | | | 6,125 % éch. 02/03/2028 | £ 600 | 783 | 0,08 | Medtronic Global Holdings S.C.A. | | | | |
| 3,250 % éch. 24/09/2027 | 300 | 335 | 0,03 | GE HealthCare Technologies, Inc. | | | | 0,375 % éch. 15/10/2028 | 400 | 393 | 0,04 | |
| BMW Canada, Inc. | | | | 5,550 % éch. 15/11/2024 | \$ 2 400 | 2 402 | 0,25 | Meta Platforms, Inc. | | | | |
| 4,760 % éch. 10/02/2025 | CAD 3 500 | 2 649 | 0,27 | Glencore Funding LLC | | | | 3,500 % éch. 15/08/2027 | \$ 1 650 | 1 607 | 0,17 | |
| (f) | | | | 4,000 % éch. 27/03/2027 | 1 500 | 1 458 | 0,15 | Motability Operations Group PLC | | | | |
| BMW Finance NV | | | | Global Payments, Inc. | | | | 0,125 % éch. 20/07/2028 | € 400 | 390 | 0,04 | |
| 3,875 % éch. 04/10/2028 | € 400 | 462 | 0,05 | 4,950 % éch. 15/08/2027 | 2 000 | 2 004 | 0,21 | Mundys SpA | | | | |
| BMW U.S. Capital LLC | | | | GN Store Nord A/S | | | | 1,625 % éch. 03/02/2025 | 1 300 | 1 397 | 0,14 | |
| 1,250 % éch. 12/08/2026 | \$ 500 | 458 | 0,05 | 0,875 % éch. 25/11/2024 | € 1 500 | 1 588 | 0,16 | National Fuel Gas Co. | | | | |
| Booking Holdings, Inc. | | | | Haleon Netherlands Capital BV | | | | 5,500 % éch. 01/10/2026 | \$ 1 000 | 1 002 | 0,10 | |
| 0,100 % éch. 08/03/2025 | € 300 | 319 | 0,03 | 1,250 % éch. 29/03/2026 | 3 700 | 3 924 | 0,40 | NetApp, Inc. | | | | |
| 4,000 % éch. 15/11/2026 | 800 | 909 | 0,09 | Haleon U.S. Capital LLC | | | | 3,300 % éch. 29/09/2024 | 200 | 197 | 0,02 | |
| Carrier Global Corp. | | | | 3,375 % éch. 24/03/2027 | \$ 750 | 722 | 0,07 | Netflix, Inc. | | | | |
| 4,375 % éch. 29/05/2025 | 1 200 | 1 337 | 0,14 | HCA, Inc. | | | | 3,625 % éch. 15/05/2027 | € 300 | 336 | 0,03 | |
| CDW LLC | | | | 5,625 % éch. 01/09/2028 | 2 000 | 2 048 | 0,21 | NextEra Energy Operating Partners LP | | | | |
| 2,670 % éch. 01/12/2026 | \$ 1 800 | 1 686 | 0,17 | HEICO Corp. | | | | 3,875 % éch. 15/10/2026 | \$ 700 | 667 | 0,07 | |
| 4,125 % éch. 01/05/2025 | 1 149 | 1 127 | 0,12 | 5,250 % éch. 01/08/2028 | 400 | 409 | 0,04 | 4,250 % éch. 15/07/2024 | 2 400 | 2 374 | 0,24 | |
| Cellnex Finance Co. S.A. | | | | Heineken NV | | | | Nordson Corp. | | | | |
| 1,000 % éch. 15/09/2027 | € 2 000 | 2 026 | 0,21 | 3,625 % éch. 15/11/2026 | € 1 300 | 1 460 | 0,15 | 5,600 % éch. 15/09/2028 | 1 000 | 1 038 | 0,11 | |
| Central Japan Railway Co. | | | | Holding d'Infrastructures de Transport SASU | | | | NTT Finance Corp. | | | | |
| 2,200 % éch. 02/10/2024 | \$ 3 300 | 3 223 | 0,33 | 0,625 % éch. 14/09/2028 | 400 | 391 | 0,04 | 4,142 % éch. 26/07/2024 | 1 800 | 1 789 | 0,18 | |
| CGI, Inc. | | | | Home Depot, Inc. | | | | 4,239 % éch. 25/07/2025 | 2 100 | 2 078 | 0,21 | |
| 1,450 % éch. 14/09/2026 | 2 700 | 2 450 | 0,25 | 2,875 % éch. 15/04/2027 | \$ 600 | 574 | 0,06 | 4,372 % éch. 27/07/2027 | 300 | 297 | 0,03 | |
| Chanel Ceres PLC | | | | HPHT Finance Ltd. | | | | Occidental Petroleum Corp. | | | | |
| 0,500 % éch. 31/07/2026 | € 1 900 | 1 958 | 0,20 | 2,875 % éch. 05/11/2024 | 700 | 686 | 0,07 | 6,375 % éch. 01/09/2028 | 1 600 | 1 683 | 0,17 | |
| Charter Communications Operating LLC | | | | Huntington Ingalls Industries, Inc. | | | | Open Text Corp. | | | | |
| 6,150 % éch. 10/11/2026 | \$ 3 800 | 3 886 | 0,40 | 3,844 % éch. 01/05/2025 | 1 200 | 1 176 | 0,12 | 6,900 % éch. 01/12/2027 | 3 200 | 3 329 | 0,34 | |
| 7,289 % éch. 01/02/2024 | 250 | 250 | 0,03 | Hyatt Hotels Corp. | | | | Oracle Corp. | | | | |
| Cheniere Energy, Inc. | | | | 1,800 % éch. 01/10/2024 | 800 | 777 | 0,08 | 1,650 % éch. 25/03/2026 | (f) | 1 900 | 1 773 | 0,18 |
| 4,625 % éch. 15/10/2028 | 5 269 | 5 147 | 0,53 | 4,850 % éch. 15/03/2026 | 300 | 298 | 0,03 | Ovintiv, Inc. | | | | |
| China Modern Dairy Holdings Ltd. | | | | Hyundai Capital America | | | | 5,650 % éch. 15/05/2025 | 1 500 | 1 508 | 0,16 | |
| 2,125 % éch. 14/07/2026 | 1 400 | 1 243 | 0,13 | 0,875 % éch. 14/06/2024 | 1 600 | 1 564 | 0,16 | PepsiCo, Inc. | | | | |
| CK Hutchison International Ltd. | | | | 1,500 % éch. 15/06/2026 | 500 | 457 | 0,05 | 4,450 % éch. 15/05/2028 | 1 300 | 1 324 | 0,14 | |
| 4,750 % éch. 21/04/2028 | 1 800 | 1 804 | 0,19 | 2,750 % éch. 27/09/2026 | 1 900 | 1 775 | 0,18 | Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. | | | | |
| CommonSpirit Health | | | | 5,800 % éch. 26/06/2025 | 500 | 503 | 0,05 | 4,450 % éch. 19/05/2028 | 900 | 900 | 0,09 | |
| 2,760 % éch. 01/10/2024 | 100 | 98 | 0,01 | 6,000 % éch. 11/07/2025 | 1 400 | 1 411 | 0,15 | Phillip Morris International, Inc. | | | | |
| Concentrix Corp. | | | | Illumina, Inc. | | | | 2,875 % éch. 03/03/2026 | € 300 | 329 | 0,03 | |
| 6,650 % éch. 02/08/2026 | 1 200 | 1 231 | 0,13 | 5,800 % éch. 12/12/2025 | 1 500 | 1 506 | 0,16 | Pioneer Natural Resources Co. | | | | |
| Continental Resources, Inc. | | | | IMCD NV | | | | 5,100 % éch. 29/03/2026 | \$ 1 000 | 1 008 | 0,10 | |
| 2,268 % éch. 15/11/2026 | 500 | 460 | 0,05 | 2,125 % éch. 31/03/2027 | € 2 700 | 2 859 | 0,29 | Qorvo, Inc. | | | | |
| Cox Communications, Inc. | | | | Imperial Brands Finance PLC | | | | 1,750 % éch. 15/12/2024 | 2 550 | 2 448 | 0,25 | |
| 5,450 % éch. 15/09/2028 | 1 000 | 1 021 | 0,11 | 3,500 % éch. 26/07/2026 | \$ 500 | 477 | 0,05 | Regal Rexnord Corp. | | | | |
| CPUK Finance Ltd. | | | | 6,125 % éch. 27/07/2027 | 1 595 | 1 639 | 0,17 | 6,050 % éch. 15/02/2026 | 500 | 506 | 0,05 | |
| 5,876 % éch. 28/08/2027 | £ 1 000 | 1 307 | 0,13 | Informa PLC | | | | Renesas Electronics Corp. | | | | |
| CSL Finance PLC | | | | 2,125 % éch. 06/10/2025 | € 300 | 322 | 0,03 | 1,543 % éch. 26/11/2024 | 4 100 | 3 947 | 0,41 | |
| 3,850 % éch. 27/04/2027 | \$ 800 | 779 | 0,08 | InterContinental Hotels Group PLC | | | | Republic Services, Inc. | | | | |
| DAE Funding LLC | | | | 1,625 % éch. 08/10/2024 | 800 | 869 | 0,09 | 3,375 % éch. 15/11/2027 | 300 | 288 | 0,03 | |
| 1,625 % éch. 15/02/2024 | 900 | 895 | 0,09 | 3,375 % éch. 08/10/2028 | £ 800 | 952 | 0,10 | Ritchie Bros Holdings, Inc. | | | | |
| 2,625 % éch. 20/03/2025 | 300 | 288 | 0,03 | International Distributions Services PLC | | | | 6,750 % éch. 15/03/2028 | 800 | 825 | 0,08 | |
| Daimler Truck Finance North America LLC | | | | 5,250 % éch. 14/09/2028 | € 1 000 | 1 147 | 0,12 | Robert Bosch GmbH | | | | |
| 5,125 % éch. 19/01/2028 | 1 300 | 1 309 | 0,13 | | | | | 3,625 % éch. 02/06/2027 | € 400 | 452 | 0,05 | |
| 5,200 % éch. 17/01/2025 | 1 100 | 1 100 | 0,11 | | | | | | | | | |
| Danfoss Finance BV | | | | | | | | | | | | |
| 0,125 % éch. 28/04/2026 | € 2 000 | 2 054 | 0,21 | | | | | | | | | |
| Dell International LLC | | | | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Pacific Gas & Electric Co. | | | | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN | | | | CDP Financial, Inc. | | | |
| 3,150 % éch. 01/01/2026 | \$ 1 000 | \$ 960 | 0,10 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | | 4,250 % éch. 25/07/2028 | 2 000 | \$ 1 997 | 0,20 |
| 3,300 % éch. 15/03/2027 | 300 | 281 | 0,03 | 4,500 % éch. 01/08/2052 | \$ 5 165 | \$ 5 011 | 0,52 | CPPIB Capital, Inc. | | | |
| 3,300 % éch. 01/12/2027 | 1 300 | 1 215 | 0,13 | 5,000 % éch. 01/02/2053 | 3 695 | 3 659 | 0,38 | 4,250 % éch. 20/07/2028 | 1 050 | 1 053 | 0,11 |
| 3,400 % éch. 15/08/2024 | 100 | 98 | 0,01 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | Obligation internationale du gouvernement français | | | |
| 3,450 % éch. 01/07/2025 | 100 | 97 | 0,01 | 3,500 % éch. 01/01/2054 | 6 800 | 6 243 | 0,64 | 0,000 % éch. 25/03/2025 | € 9 000 | 9 603 | 0,99 |
| 3,500 % éch. 15/06/2025 | 1 700 | 1 648 | 0,17 | 4,000 % éch. 01/01/2054 | 56 500 | 53 487 | 5,50 | (b) | | | |
| 3,750 % éch. 15/02/2024 | 550 | 548 | 0,06 | 5,000 % éch. 01/02/2054 | 600 | 594 | 0,06 | Obligation internationale du gouvernement israélien | | | |
| 4,950 % éch. 08/06/2025 | 2 000 | 1 988 | 0,20 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 12 100 | 12 287 | 1,26 | 5,000 % éch. 30/10/2026 | 800 | 904 | 0,09 |
| Pennsylvania Electric Co. | | | | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 2 100 | 2 152 | 0,22 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 4,150 % éch. 15/04/2025 | 1 950 | 1 913 | 0,20 | | | | | 0,000 % éch. 01/04/2026 | € 2 700 | \$ 2 801 | 0,29 |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara | | | | | | | | (b) | | | |
| 4,125 % éch. 15/05/2027 | 1 200 | 1 168 | 0,12 | | | | | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | |
| Potomac Electric Power Co. | | | | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMERICAIN | | | | 3,000 % éch. 03/12/2026 | | | |
| 3,600 % éch. 15/03/2024 | 1 262 | 1 256 | 0,13 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c) | | | | (c) | | | |
| Public Service Enterprise Group, Inc. | | | | 0,250 % éch. 15/01/2025 | 1 819 | 1 765 | 0,18 | République d'Allemagne | | | |
| 2,875 % éch. 15/06/2024 | 2 900 | 2 864 | 0,29 | 2,375 % éch. 15/01/2025 | 1 632 | 1 620 | 0,17 | 2,500 % éch. 13/03/2025 | € 6 700 | 7 373 | 0,76 |
| 5,875 % éch. 15/10/2028 | 1 400 | 1 468 | 0,15 | Billets du Trésor américain | | | | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | | | |
| San Diego Gas & Electric Co. | | | | 4,125 % éch. 31/01/2025 | | | | 10,500 % éch. 21/12/2026 ZAR | 139 500 | 7 986 | 0,82 |
| 2,500 % éch. 15/05/2026 | 226 | 216 | 0,02 | (g) | 13 700 | 13 617 | 1,40 | Obligation internationale du gouvernement espagnol | | | |
| Sempra | | | | 4,375 % éch. 31/10/2024 | | | | 0,000 % éch. 31/01/2028 | | | |
| 3,300 % éch. 01/04/2025 | 3 100 | 3 027 | 0,31 | (h) | 17 100 | 17 028 | 1,75 | (b) | € 4 100 | 4 092 | 0,42 |
| Southern California Edison Co. | | | | | | | | Bon du Trésor britannique | | | |
| 0,975 % éch. 01/08/2024 | 800 | 779 | 0,08 | | | | | 1,625 % éch. 22/10/2028 | £ 7 200 | 8 500 | 0,87 |
| 4,200 % éch. 01/06/2025 | 2 200 | 2 176 | 0,22 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | |
| 5,300 % éch. 01/03/2028 | 1 500 | 1 541 | 0,16 | GSR Mortgage Loan Trust | | | | ACTIONS ORDINAIRES | | | |
| 5,850 % éch. 01/11/2027 | 100 | 105 | 0,01 | 4,836 % éch. 25/09/2035 | 2 | 2 | 0,00 | SERVICES FINANCIERS | | | |
| 6,266 % éch. 01/04/2024 | 557 | 557 | 0,06 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | Stearns Holdings | | | |
| Southern Power Co. | | | | 5,971 % éch. 25/11/2034 | 2 | 2 | 0,00 | LLC « B » (a) | 43 861 | 0 | 0,00 |
| 0,900 % éch. 15/01/2026 | 3 000 | 2 765 | 0,28 | 6,289 % éch. 25/09/2034 | 253 | 253 | 0,03 | BONS DE SOUSCRIPTION | | | |
| Sprint LLC | | | | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | Guaranteed Rate, Inc. - Exp. | | | |
| 7,125 % éch. 15/06/2024 | 125 | 126 | 0,01 | 6,157 % éch. 25/01/2033 | 4 | 3 | 0,00 | 31/12/2060 | 211 | 0 | 0,00 |
| State Grid Overseas Investment BVI Ltd. | | | | 6,262 % éch. 25/01/2047 | 164 | 145 | 0,01 | | | | |
| 0,797 % éch. 05/08/2026 | € 500 | 516 | 0,05 | | | | | | | | |
| System Energy Resources, Inc. | | | | | | | | | | | |
| 2,140 % éch. 09/12/2025 | \$ 1 150 | 1 071 | 0,11 | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | | | | |
| Tampa Electric Co. | | | | Bumper NL BV | | | | | | | |
| 3,875 % éch. 12/07/2024 | 800 | 793 | 0,08 | 4,529 % éch. 22/03/2035 | € 4 000 | 4 426 | 0,45 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| TDC Net A/S | | | | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | BILLETTS À COURT TERME | | | |
| 5,056 % éch. 31/05/2028 | € 2 000 | 2 300 | 0,24 | 6,090 % éch. 25/12/2035 | \$ 266 | 257 | 0,03 | American Honda Finance Corp. | | | |
| Telecom Italia SpA | | | | OCP Euro CLO DAC | | | | 5,967 % éch. 07/06/2024 | \$ 2 950 | 2 952 | 0,31 |
| 7,875 % éch. 31/07/2028 | 1 200 | 1 476 | 0,15 | 5,873 % éch. 20/01/2033 | € 1 000 | 1 105 | 0,11 | Yango Justice International Ltd. | | | |
| Teollisuuden Voima Oyj | | | | | | | | 5,300 % éch. 11/01/2022 ^ | 200 | 1 | 0,00 |
| 1,125 % éch. 09/03/2026 | 300 | 313 | 0,03 | | | | | Total des Instruments à court terme | | | |
| Trans-Allegheny Interstate Line Co. | | | | | | | | | | | |
| 3,850 % éch. 01/06/2025 | \$ 1 305 | 1 279 | 0,13 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | Total des Valeurs mobilières | \$ 1 024 085 | 105,27 | |
| Verizon Communications, Inc. | | | | Obligation internationale du gouvernement australien | | | | | | | |
| 6,218 % éch. 20/03/2026 | 447 | 447 | 0,05 | 2,750 % éch. 21/11/2028 AUD | 41 600 | 27 271 | 2,80 | ACTIONS | | | |
| Vistra Operations Co. LLC | | | | Obligation internationale du gouvernement belge | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| 3,550 % éch. 15/07/2024 | 3 325 | 3 279 | 0,34 | 0,800 % éch. 22/06/2028 | € 2 500 | 2 598 | 0,27 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| WEC Energy Group, Inc. | | | | Cassa Depositi e Prestiti SpA | | | | PIMCO Select Funds plc - | | | |
| 4,750 % éch. 09/01/2026 | 1 500 | 1 495 | 0,15 | 5,750 % éch. 05/05/2026 | \$ 2 000 | 1 999 | 0,21 | Fonds PIMCO | | | |
| | | 112 510 | 11,56 | | | | | US Dollar Short-Term | | | |
| Total Obligations et billets privés | | 812 914 | 83,56 | | | | | Floating NAV Fund (d) | 1 623 396 | 16 177 | 1,66 |
| OBLIGATIONS ET BILLETTS MUNICIPAUX | | | | | | | | PIMCO Specialty Funds | | | |
| Billets State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020 | | | | | | | | Ireland p.l.c. - Fonds | | | |
| 1,258 % éch. 01/07/2025 | 1 200 | 1 139 | 0,12 | | | | | PIMCO China Bond Fund | 5 163 | 70 | 0,01 |
| | | | | | | | | (d) | | | |
| | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement | \$ 16 247 | 1,67 | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux préteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 678 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | \$ (692) | \$ 678 | \$ 678 | 0,07 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (692) | \$ 678 | \$ 678 | 0,07 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2024 | 16 | \$ 37 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Long | 03/2024 | 45 | 96 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 19 | 36 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 222 | (1 265) | (0,13) |
| | | | | \$ (1 096) | (0,11) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (1 096) | (0,11) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|---|------------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/12/2024 | \$ 1 300 | \$ (13) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/12/2025 | 200 | (2) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 1 200 | 25 | 0,01 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2024 | 1 500 | 47 | 0,01 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 1 300 | 22 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/06/2027 | 1 200 | 87 | 0,01 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/06/2028 | € 1 500 | 19 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | \$ 3 700 | 11 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 400 | 3 | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20/12/2026 | 80 | (6) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20/06/2028 | 95 | 3 | 0,00 |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20/06/2028 | € 500 | 8 | 0,00 |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20/12/2028 | 400 | 14 | 0,00 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | \$ 300 | (4) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2024 | € 2 200 | 26 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2025 | 500 | 15 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2027 | \$ 200 | 5 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 1 800 | 25 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 500 | 7 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20/06/2024 | € 1 200 | (16) | 0,00 |
| | | | | \$ 276 | 0,03 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.IG-39 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2027 | \$ 100 | \$ 1 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2028 | 600 | 4 | 0,00 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 44 800 | 318 | 0,04 |
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | € 500 | 25 | 0,00 |
| Indice iTraxx Europe Main 40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 12 400 | 122 | 0,01 |
| | | | | \$ 470 | 0,05 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|------------------------|
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,399 % | 18/06/2028 | ¥ 77 700 | \$ 14 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 18/07/2024 | \$ 19 000 | 15 | 0,00 |
| À payer | Bon bancaire en CAD à 3 mois | 2,250 | 15/06/2024 | CAD 3 000 | 13 | 0,00 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/09/2025 | 34 300 | 414 | 0,04 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | 57 100 | 689 | 0,07 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,300 | 28/04/2027 | ZAR 68 300 | 58 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | € 1 700 | (56) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 4 400 | (265) | (0,03) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 3 200 | (159) | (0,02) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 35 200 | 1 413 | 0,15 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 20 300 | 370 | 0,04 |
| | | | | | \$ 2 506 | 0,25 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 3 252 | 0,33 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 100 | \$ (3) | \$ 4 | \$ 1 | 0,00 |
| GST | AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 800 | (9) | 17 | 8 | 0,00 |
| JPM | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | 700 | (16) | 16 | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ (28) | \$ 37 | \$ 9 | 0,00 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|--------|
| BOA | 01/2024 | AUD | 612 | \$ 405 | \$ 0 | \$ (13) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 1 609 | 2 041 | 0 | (9) | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 2 291 | ¥ 338 109 | 110 | 0 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 193 | NOK | 2 049 | 9 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 302 | INR | 25 290 | 1 | 0,00 | |
| BPS | 01/2024 | AUD | 1 342 | \$ 887 | 0 | (29) | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 4 566 | 5 791 | 0 | (29) | 0,00 | |
| | 01/2024 | HUF | 145 098 | 393 | 0 | (26) | 0,00 | |
| | 01/2024 | ¥ | 9 100 | 62 | 0 | (3) | 0,00 | |
| | 01/2024 | MXN | 116 025 | 6 328 | 0 | (493) | (0,05) | |
| | 01/2024 | \$ | 954 | CAD | 1 297 | 30 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 5 025 | € | 4 592 | 52 | 0,01 | |
| | 01/2024 | ZAR | 64 977 | \$ | 3 505 | 0 | (43) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 59 | IDR | 902 888 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 050 | INR | 87 845 | 2 | 0,00 | |
| BRC | 01/2024 | € | 219 597 | \$ | 241 508 | 0 | (1 126) | (0,12) |
| | 02/2024 | \$ | 113 | THY | 3 453 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 | THB | 25 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 574 | TRY | 18 029 | 0 | (7) | 0,00 |
| | 04/2024 | | 615 | | 19 804 | 0 | (9) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € | 134 | \$ | 145 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 36 706 | | 2 108 | 0 | (49) | (0,01) |
| | 01/2024 | ZAR | 66 482 | | 3 495 | 0 | (136) | (0,02) |
| | 02/2024 | \$ | 916 | BRL | 4 507 | 10 | 0,00 | |
| GLM | 01/2024 | AUD | 39 415 | \$ | 25 924 | 0 | (977) | (0,10) |
| | 01/2024 | CAD | 16 681 | | 12 275 | 0 | (377) | (0,04) |
| | 01/2024 | \$ | 2 177 | CAD | 2 954 | 64 | 0,01 | |
| | 01/2024 | | 1 829 | MXN | 32 066 | 56 | 0,01 | |
| | 01/2024 | ZAR | 19 010 | \$ | 1 001 | 0 | (37) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 249 | IDR | 3 827 126 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 125 | TRY | 3 936 | 0 | (1) | 0,00 |
| JPM | 02/2024 | | 921 | BRL | 4 516 | 7 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 260 | IDR | 4 008 196 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 315 | INR | 26 330 | 0 | 0,00 | |
| MBC | 01/2024 | € | 5 154 | \$ | 5 598 | 0 | (97) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ | 317 | IDR | 4 882 050 | 0 | 0,00 | |
| MYI | 01/2024 | CAD | 1 419 | \$ | 1 076 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | € | 209 | | 233 | 1 | 0,00 | |
| | 01/2024 | £ | 23 | | 29 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | \$ | 340 | € | 307 | 0 | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 44 | £ | 34 | 0 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 871 | ¥ | 128 436 | 40 | 0,00 | |
| | 01/2024 | | 400 | ZAR | 7 349 | 1 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 357 | IDR | 20 883 468 | 0 | (3) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | ZAR | 3 118 | \$ | 164 | 0 | (6) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 52 | IDR | 790 390 | 0 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 685 | INR | 57 323 | 1 | 0,00 | |
| | 03/2024 | | 1 678 | THB | 58 007 | 33 | 0,00 | |
| TOR | 01/2024 | | 1 440 | ¥ | 211 214 | 59 | 0,01 | |
| UAG | 01/2024 | £ | 24 806 | \$ | 31 393 | 0 | (231) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ | 1 068 | NOK | 11 396 | 54 | 0,01 | |
| | | | | | \$ 530 | \$ (3 711) | \$ (3 181) | (0,33) |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 719 | \$ 1 890 | \$ 4 | \$ (13) | \$ (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 213 053 | € 193 680 | 944 | 0 | 944 | 0,10 |
| BRC | 01/2024 | 206 095 | 187 396 | 961 | 0 | 961 | 0,10 |
| | 01/2024 | € 1 359 | \$ 1 489 | 1 | (15) | (14) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | \$ 327 | € 301 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 357 | \$ 385 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 772 | € 706 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | 206 129 | 187 396 | 926 | 0 | 926 | 0,09 |
| | | | | \$ 2 850 | \$ (37) | \$ 2 813 | 0,29 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 32 | \$ 40 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 975 | £ 769 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 1 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 493 | £ 1 177 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 28 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 162 | \$ 205 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| CBK | 01/2024 | \$ 14 | £ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 11 | \$ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 74 | 94 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 | £ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 30 | \$ 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 605 | £ 6 803 | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | 6 003 | 4 758 | 62 | 0 | 62 | 0,01 |
| | 01/2024 | £ 10 | \$ 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 8 604 | £ 6 798 | 63 | 0 | 63 | 0,01 |
| | | | | \$ 205 | \$ (2) | \$ 203 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 774 | NOK 8 230 | \$ 36 | \$ 0 | \$ 36 | 0,00 |
| | 01/2024 | 999 | 10 684 | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | 960 | 10 324 | 57 | 0 | 57 | 0,01 |
| | 01/2024 | NOK 1 946 | \$ 184 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | \$ 136 | NOK 1 468 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | | | | \$ 154 | \$ (7) | \$ 147 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SEK (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| CBK | 01/2024 | \$ 9 952 | SEK 103 152 | \$ 286 | \$ 0 | \$ 286 | 0,03 |
| | 01/2024 | 9 952 | 103 152 | 286 | 0 | 286 | 0,03 |
| GLM | 01/2024 | 1 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 9 750 | 101 257 | 301 | 0 | 301 | 0,03 |
| SCX | 01/2024 | | | | | | |
| | | | | \$ 873 | \$ 0 | \$ 873 | 0,09 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 864 0,09

Total des Investissements

\$ 1 044 030 107,32

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (71 187) (7,32)

Actifs nets

\$ 972 843 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 1,31 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|-----------|--------------|---------------------|
| BMW Canada, Inc. | 4,760 % | 10/02/2025 | 07/02/2023 | \$ 2 601 | \$ 2 649 | 0,27 |
| Citigroup, Inc. | 2,014 | 25/01/2026 | 18/01/2022 | 2 000 | 1 923 | 0,20 |
| Citigroup, Inc. | 3,290 | 17/03/2026 | 10/03/2022 | 3 200 | 3 117 | 0,32 |
| Deutsche Bank AG | 1,447 | 01/04/2025 | 30/03/2021 | 1 600 | 1 581 | 0,16 |
| Deutsche Bank AG | 2,129 | 24/11/2026 | 17/11/2020 | 500 | 469 | 0,05 |
| Oracle Corp. | 1,650 | 25/03/2026 | 22/03/2021 | 1 900 | 1 773 | 0,18 |
| | | | | \$ 11 801 | \$ 11 512 | 1,18 |

(g) Un titre d'une juste valeur globale de 6 858 \$ (31 décembre 2022 : 12 682 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 4 780 \$ (31 décembre 2022 : 1 396 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 9 560 \$ (31 décembre 2022 : 9 433 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 1 630 \$ (31 décembre 2022 : 426 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|--------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 023 969 | \$ 116 | \$ 1 024 085 |
| Fonds d'investissement | 16 247 | 0 | 0 | 16 247 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 678 | 0 | 678 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 96 | 2 924 | 0 | 3 020 |
| Totaux | \$ 16 343 | \$ 1 027 571 | \$ 116 | \$ 1 044 030 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|--------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 691 422 | \$ 0 | \$ 691 422 |
| Fonds d'investissement | 643 | 0 | 0 | 643 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 604 | 0 | 1 604 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (614) | 2 737 | 0 | 2 123 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (14 029) | 0 | (14 029) |
| Totaux | \$ 29 | \$ 681 734 | \$ 0 | \$ 681 763 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BOS | 5,750 % | 28/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (6 969) | \$ (6 973) | (0,72) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (6 973) | (0,72) |

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BRC | 5,730 % | 28/12/2023 | 02/01/2024 | \$ (4 814) | \$ (4 817) | (0,50) |
| Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (4 817) | (0,50) |

⁽¹⁾ Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 \$ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ 140 | \$ 0 | \$ 140 | \$ (35) | \$ 0 | \$ (35) |
| BPS | 399 | (1 610) | (1 211) | (202) | 140 | (62) |
| BRC | (182) | 370 | 188 | 146 | (120) | 26 |
| CBK | 151 | (260) | (109) | 4 468 | (4 360) | 108 |
| DUB | 286 | (260) | 26 | S/O | S/O | S/O |
| GLM | (1 215) | 1 260 | 45 | (12) | 16 | 4 |
| GST | 8 | 0 | 8 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | 7 | 0 | 7 | 84 | 0 | 84 |
| MBC | (98) | 0 | (98) | 170 | (290) | (120) |
| MYI | 37 | (10) | 27 | (74) | 0 | (74) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | 13 | 0 | 13 |
| RYL | (7) | 0 | (7) | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 405 | (590) | (185) | 4 065 | (3 850) | 215 |
| SSB | 62 | 0 | 62 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 59 | 0 | 59 | 6 | (20) | (14) |
| UAG | 812 | (1 850) | (1 038) | (199) | 270 | 71 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 75,46 | 73,17 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 29,48 | 32,43 |
| Autres valeurs mobilières | 0,33 | S/O |
| Fonds d'investissement | 1,67 | 0,10 |
| Contrats de mise en pension | 0,07 | 0,24 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,11) | 0,05 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,33 | (1,02) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,09 | 1,30 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (2,14) |
| Contrats de prise en pension | (0,72) | (1,95) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (0,50) | (0,22) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 0,02 | 0,55 |
| Obligations et billets privés | 83,56 | 83,16 |
| Obligations et billets municipaux | 0,12 | 0,17 |
| Agences du gouvernement américain | 8,58 | 6,33 |
| Obligations du Trésor américain | 3,50 | 10,55 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 0,04 | 0,07 |
| Titres adossés à des actifs | 0,59 | 0,22 |
| Émissions souveraines | 8,55 | 3,40 |
| Actions ordinaires | 0,00 | 0,00 |
| Bons de souscription | 0,00 | 0,00 |
| Instruments à court terme | 0,31 | 1,15 |
| Fonds d'investissement | 1,67 | 0,10 |
| Contrats de mise en pension | 0,07 | 0,24 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,11) | 0,05 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03 | (0,03) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,05 | 0,01 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,25 | (1,00) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,01 |
| Contrats de change à terme | (0,33) | (0,48) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,42 | 1,77 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (2,14) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (7,32) | (4,13) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | INDUSTRIE | | | | | |
| American Airlines, Inc. | \$ 10,427 | \$ 833 | 0,04 | Bevco Lux SARL | € 4 400 | \$ 4 078 | 0,20 | 6,442 % éch. 11/08/2028 | \$ 3 150 | \$ 3 273 | 0,16 | | |
| Carnival Corp. | € 7,593 | € 3 733 | 0,18 | BPCE S.A. | \$ 1,652 | 279 | 0,01 | 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 1 200 | 1 530 | 0,08 | | |
| Emerald TopCo, Inc. | \$ 8,970 | \$ 71 | 0,00 | 6,612 % éch. 19/10/2027 | 16 950 | 17 456 | 0,86 | Unique Pub Finance Co. PLC | £ 7,395 | 8 | 0,00 | | |
| Envision Healthcare Corp. | 13,258 % éch. 15/09/2028 | 819 | 0,04 | Brandywine Operating Partnership LP | 3,950 % éch. 15/11/2027 | 100 | 0,00 | Uniti Group LP | \$ 6,500 | 1 355 | 0,07 | | |
| iHeartCommunications, Inc. | 8,470 % éch. 01/05/2026 | 6 168 | 0,26 | CaixaBank S.A. | 6,684 % éch. 13/09/2027 | 5 000 | 0,25 | 10,500 % éch. 15/02/2028 | \$ 2 508 | 2 545 | 0,13 | | |
| Lealand Finance Co. BV | 8,720 % éch. 01/05/2026 | 564 | 0,03 | Corsair International Ltd. | 8,802 % éch. 28/01/2027 | € 1 000 | 0,05 | VICI Properties LP | 3,750 % éch. 15/02/2027 | 3 800 | 3 589 | 0,18 | |
| Lealand Finance Co. BV (6,470 % en numéraire et 3,000 % de rémunération en nature) | 9,470 % éch. 30/06/2025 | 25 | 0,00 | Crédit Agricole S.A. | 6,316 % éch. 03/10/2029 | \$ 5 900 | 0,30 | 3,875 % éch. 15/02/2029 | 5 000 | 4 597 | 0,23 | | |
| Poseidon Bidco SASU | € 9,175 | € 4 424 | 0,22 | Credit Suisse AG | 5,500 % éch. 20/08/2026 | € 1 400 | 0,08 | 4,500 % éch. 01/09/2026 | 2 000 | 1 937 | 0,10 | | |
| PUG LLC | \$ 8,970 | \$ 28 | 0,00 | Credit Suisse AG AT1 Claim | \$ 1 900 | 228 | 0,01 | 4,500 % éch. 15/01/2028 | 4 325 | 4 129 | 0,20 | | |
| Surgery Center Holdings, Inc. | 8,856 % éch. 19/12/2030 | 1 900 | 0,10 | Cromwell Ereit Lux Finco SARL | 2,125 % éch. 19/11/2025 | € 1 407 | 0,07 | 4,625 % éch. 01/12/2029 | 4 900 | 4 622 | 0,23 | | |
| Syniverse Holdings, Inc. | 12,348 % éch. 13/05/2027 | 1 611 | 0,07 | Deutsche Bank AG | 3,547 % éch. 18/09/2031 | \$ 1 200 | 0,05 | Wells Fargo & Co. | 2,188 % éch. 30/04/2026 | 1 600 | 1 534 | 0,08 | |
| TransDigm, Inc. | 8,598 % éch. 24/08/2028 | 11 987 | 0,60 | 6,720 % éch. 18/01/2029 | 200 | 210 | 0,01 | 6,303 % éch. 23/10/2029 | 2 700 | 2 847 | 0,14 | | |
| U.S. Renal Care, Inc. | 10,470 % éch. 20/06/2028 | 248 | 0,01 | 6,819 % éch. 20/11/2029 | 5 700 | 6 005 | 0,30 | | | 241 973 | 11,92 | | |
| Westmoreland Coal Co. | 8,000 % éch. 04/11/2030 | 6 | 0,00 | EPR Properties | 4,500 % éch. 01/06/2027 | 300 | 0,01 | ALASKA AIRLINES PASS-THROUGH TRUST | | | | | |
| Windstream Services LLC | 11,706 % éch. 21/09/2027 | 3 | 0,00 | 4,750 % éch. 15/12/2026 | 8 | 8 | 0,00 | 4,800 % éch. 15/02/2029 | 3 059 | 2 977 | 0,15 | | |
| Wm Morrison Supermarkets Ltd. | 8,752 % éch. 04/11/2027 | € 2 374 | 0,12 | 4,950 % éch. 15/04/2028 | 34 | 32 | 0,00 | Altice France S.A. | 8,125 % éch. 01/02/2027 | 2 100 | 1 938 | 0,10 | |
| | | 33 844 | 1,67 | Equinix, Inc. | 2,900 % éch. 18/11/2026 | 100 | 0,00 | American Airlines Pass-Through Trust | 3,000 % éch. 15/04/2030 | 202 | 182 | 0,01 | |
| OBLIGATIONS ET BILLETTS PRIVÉS | | | | Extra Space Storage LP | 5,900 % éch. 15/01/2031 | 500 | 0,03 | 3,375 % éch. 01/11/2028 | 58 | 53 | 0,00 | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | GLP Capital LP | 4,000 % éch. 15/01/2030 | 100 | 0,00 | BAT International Finance PLC | 5,931 % éch. 02/02/2029 | 6 300 | 6 550 | 0,32 | |
| ABN AMRO Bank NV | \$ 6,339 | \$ 818 | 0,04 | 4,000 % éch. 15/01/2031 | 300 | 271 | 0,01 | Bayer U.S. Finance LLC | 6,125 % éch. 21/11/2026 | 4 300 | 4 373 | 0,22 | |
| Adler Financing SARL (12,500 % en numéraire ou 12,500 % de rémunération en nature) | € 5 771 | € 6 730 | 0,33 | 5,300 % éch. 15/01/2029 | 3 888 | 3 868 | 0,19 | British Airways Pass-Through Trust | 4,250 % éch. 15/05/2034 | 450 | 420 | 0,02 | |
| AGPS BondCo PLC | \$ 5,000 | \$ 3 090 | 0,15 | 5,750 % éch. 01/06/2028 | 500 | 505 | 0,02 | Broadcom, Inc. | 3,469 % éch. 15/04/2034 | 2 303 | 2 005 | 0,10 | |
| AIB Group PLC | \$ 7 540 | \$ 9 012 | 0,44 | 6,750 % éch. 01/12/2033 | 300 | 324 | 0,02 | Carvana Co. | 12,000 % éch. 01/12/2028 | 794 | 643 | 0,03 | |
| Ally Financial, Inc. | \$ 2 100 | \$ 2 104 | 0,10 | Goldman Sachs Group, Inc. | 3,750 % éch. 25/02/2026 | 1 400 | 0,07 | 13,000 % éch. 01/06/2030 | 2 872 | 2 294 | 0,11 | | |
| American Tower Corp. | \$ 3,650 | \$ 1 444 | 0,07 | 6,484 % éch. 24/10/2029 | 4 600 | 4 884 | 0,24 | 14,000 % éch. 01/06/2031 | 3 381 | 2 733 | 0,13 | | |
| Aroundtown S.A. | € 1,500 | € 8 700 | 0,42 | HSBC Holdings PLC | 2,848 % éch. 04/06/2031 | 5 900 | 0,25 | CDW LLC | 2,670 % éch. 01/12/2026 | 6 460 | 6 050 | 0,30 | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. | \$ 1 340 | \$ 1 188 | 0,06 | 2,848 % éch. 04/06/2031 | 3 100 | 2 988 | 0,15 | CGI, Inc. | 1,450 % éch. 14/09/2026 | 2 000 | 1 815 | 0,09 | |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | € 1,875 | € 3 152 | 0,16 | 4,041 % éch. 13/03/2028 | 300 | 2 988 | 0,15 | Community Health Systems, Inc. | 5,625 % éch. 15/03/2027 | 3 393 | 3 157 | 0,16 | |
| Banco de Crédito del Perú S.A. | 4,650 % éch. 17/09/2024 | PEN 600 | 0,01 | 5,887 % éch. 14/08/2027 | 200 | 203 | 0,01 | CoStar Group, Inc. | 2,800 % éch. 15/07/2030 | 2 500 | 2 128 | 0,10 | |
| Banco Santander S.A. | \$ 1 200 | \$ 1 112 | 0,05 | Intesa Sanpaolo SpA | 7,200 % éch. 28/11/2033 | 700 | 0,04 | Delta Air Lines Pass-Through Trust | 2,000 % éch. 10/12/2029 | 198 | 176 | 0,01 | |
| Bank of America Corp. | \$ 3,419 | \$ 471 | 0,02 | JPMorgan Chase & Co. | 2,083 % éch. 22/04/2026 | 800 | 0,04 | DISH DBS Corp. | 5,250 % éch. 01/12/2026 | 2 550 | 2 190 | 0,11 | |
| Barclays PLC | 2 000 | 1 965 | 0,10 | 6,070 % éch. 22/10/2027 | 3 700 | 3 808 | 0,19 | 5,750 % éch. 01/12/2028 | 2 520 | 2 015 | 0,10 | | |
| | 1 000 | 1 005 | 0,05 | KBC Group NV | 5,796 % éch. 19/01/2029 | 2 100 | 0,11 | Energy Transfer LP | 6,050 % éch. 01/12/2026 | 7 300 | 7 510 | 0,37 | |
| | 1 355 | 1 406 | 0,07 | Lloyds Banking Group PLC | 3,750 % éch. 11/01/2027 | 2 500 | 0,12 | Global Payments, Inc. | 1,200 % éch. 01/03/2026 | 600 | 551 | 0,03 | |
| | 2 900 | 2 983 | 0,15 | Morgan Stanley | 2,188 % éch. 28/04/2026 | 300 | 0,01 | Intelsat Jackson Holdings S.A. | 6,500 % éch. 15/03/2030 | 5 897 | 5 632 | 0,28 | |
| | 500 | 535 | 0,03 | Nationwide Building Society | 4,302 % éch. 08/03/2029 | 2 100 | 0,10 | JetBlue Pass-Through Trust | 4,000 % éch. 15/05/2034 | 2 652 | 2 435 | 0,12 | |
| | | | | NatWest Group PLC | 6,557 % éch. 18/10/2027 | 14 000 | 0,71 | Market Bidco Finco PLC | 4,750 % éch. 04/11/2027 | € 2 100 | 2 086 | 0,10 | |
| | | | | Santander UK Group Holdings PLC | 6,750 % éch. 24/06/2024 | € 4 169 | 0,26 | Mitchells & Butlers Finance PLC | 6,013 % éch. 15/12/2030 | £ 35 | 42 | 0,00 | |
| | | | | (h)(i) | 6,833 % éch. 21/11/2026 | \$ 5 700 | 0,29 | Motorola Solutions, Inc. | 2,300 % éch. 15/11/2030 | \$ 4 383 | 3 703 | 0,18 | |
| | | | | (j) | 7,482 % éch. 29/08/2029 | £ 700 | 0,05 | Nissan Motor Co. Ltd. | 4,345 % éch. 17/09/2027 | 2 800 | 2 681 | 0,13 | |
| | | | | | SLM Student Loan Trust | € 2 923 | 0,15 | 8,810 % éch. 17/09/2030 | 300 | 281 | 0,01 | | |
| | | | | | Société Générale S.A. | \$ 3 200 | 0,16 | NMG Holding Co., Inc. | 7,125 % éch. 01/04/2026 | 400 | 385 | 0,02 | |
| | | | | | Standard Chartered PLC | 6,170 % éch. 09/01/2027 | 1 400 | 0,07 | NPC Ukrenegro | 6,875 % éch. 09/11/2028 | 200 | 54 | 0,00 |
| | | | | | 6,750 % éch. 08/02/2028 | 11 219 | 0,57 | Petroleos de Venezuela S.A. | 6,000 % éch. 16/05/2034 | 220 | 25 | 0,00 | |
| | | | | | UBS AG | 5,125 % éch. 15/05/2024 | 3 490 | 0,17 | Petroleos Mexicanos | 5,950 % éch. 28/01/2031 | 4 300 | 3 439 | 0,17 |
| | | | | | (j) | 3 490 | 0,17 | 6,700 % éch. 16/02/2032 | 1 831 | 1 521 | 0,07 | | |
| | | | | | UBS Group AG | 4,194 % éch. 01/04/2031 | 5 000 | 0,23 | | | | | |
| | | | | | 6,246 % éch. 22/09/2029 | 400 | 0,02 | | | | | | |
| | | | | | 6,327 % éch. 22/12/2027 | 3 100 | 0,16 | | | | | | |
| | | | | | 6,373 % éch. 15/07/2026 | 2 700 | 0,13 | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Low Duration INCOME Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Prime Healthcare Services, Inc. | | | | Ginnie Mae, TBA | | | | Banc of America Merrill Lynch Trust | | | |
| 7,250 % éch. 01/11/2025 | \$ 6 355 | \$ 6 203 | 0,31 | 2,500 % éch. 01/01/2054 | \$ 900 | \$ 787 | 0,04 | 4,185 % éch. 15/08/2046 | \$ 680 | \$ 534 | 0,03 |
| RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. | | | | 3,000 % éch. 01/02/2054 | 500 | 453 | 0,02 | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust | | | |
| 9,750 % éch. 01/12/2026 | 4 100 | 4 072 | 0,20 | 3,500 % éch. 01/01/2054 | 5 000 | 4 657 | 0,23 | 3,966 % éch. 10/08/2033 | 635 | 591 | 0,03 |
| Rivian Holdings LLC | | | | 4,000 % éch. 01/02/2054 | 2 700 | 2 581 | 0,13 | Bear Stearns ALT-A Trust | | | |
| 11,493 % éch. 15/10/2026 | 3 200 | 3 206 | 0,16 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 10 900 | 10 649 | 0,52 | 4,454 % éch. 25/09/2035 | 2 132 | 830 | 0,04 |
| RTX Corp. | | | | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 1 000 | 993 | 0,05 | Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust | | | |
| 5,750 % éch. 15/01/2029 | 4 000 | 4 184 | 0,21 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | | 4,805 % éch. 26/01/2036 | 4 167 | 3 084 | 0,15 |
| Sandoz Finance BV | | | | 3,500 % éch. 01/11/2047 | 86 | 80 | 0,00 | Brants Bridge PLC | | | |
| 3,970 % éch. 17/04/2027 | € 5 400 | 6 089 | 0,30 | 4,000 % éch. 01/11/2042 - 01/03/2049 | 1 624 | 1 563 | 0,08 | 6,120 % éch. 14/06/2066 | £ 4 933 | 6 277 | 0,31 |
| Sands China Ltd. | | | | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | BX Trust | | | |
| 4,300 % éch. 08/01/2026 | \$ 1 200 | 1 153 | 0,06 | 2,500 % éch. 01/02/2054 | 20 600 | 17 550 | 0,86 | 6,776 % éch. 15/11/2032 | \$ 665 | 660 | 0,03 |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust | | | | 3,000 % éch. 01/02/2054 | 25 450 | 22 540 | 1,11 | 6,926 % éch. 15/11/2032 | 1 400 | 1 384 | 0,07 |
| 4,100 % éch. 01/10/2029 | 394 | 363 | 0,02 | 3,500 % éch. 01/02/2054 | 81 450 | 74 807 | 3,69 | 7,429 % éch. 15/05/2035 | 1 080 | 1 061 | 0,05 |
| Surgery Center Holdings, Inc. | | | | 4,000 % éch. 01/01/2054 | 128 650 | 121 777 | 6,00 | Canada Square Funding PLC | | | |
| 10,000 % éch. 15/04/2027 | 1 825 | 1 848 | 0,09 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 31 100 | 30 168 | 1,49 | 6,070 % éch. 17/01/2059 | £ 10 633 | 13 476 | 0,66 |
| T-Mobile USA, Inc. | | | | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 158 300 | 156 645 | 7,72 | Canterbury Finance PLC | | | |
| 4,800 % éch. 15/07/2028 | 5 500 | 5 549 | 0,27 | 5,500 % éch. 01/01/2054 | 255 200 | 256 322 | 12,63 | 6,046 % éch. 16/05/2058 | 11 447 | 14 565 | 0,72 |
| Topaz Solar Farms LLC | | | | 6,000 % éch. 01/01/2054 | 294 500 | 299 046 | 14,73 | ChaseFlex Trust | | | |
| 4,875 % éch. 30/09/2039 | 35 | 32 | 0,00 | 6,500 % éch. 01/01/2054 | 170 400 | 174 625 | 8,60 | 6,150 % éch. 25/05/2037 | \$ 13 | 12 | 0,00 |
| 5,750 % éch. 30/09/2039 | 191 | 190 | 0,01 | 7,000 % éch. 01/03/2054 | 5 800 | 5 973 | 0,29 | Cheshire PLC | | | |
| U.S. Renal Care, Inc. | | | | | | | | 7,820 % éch. 20/08/2045 | £ 1 168 | 1 465 | 0,07 |
| 10,625 % éch. 28/06/2028 | 14 | 11 | 0,00 | | | | | Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates | | | |
| United Airlines Pass-Through Trust | | | | | | | | 5,411 % éch. 25/08/2035 | \$ 1 039 | 815 | 0,04 |
| 2,700 % éch. 01/11/2033 | 167 | 141 | 0,01 | | | | | Citigroup Commercial Mortgage Trust | | | |
| 3,100 % éch. 07/01/2030 | 1 914 | 1 748 | 0,09 | | | | | 3,518 % éch. 10/05/2035 | 15 420 | 14 294 | 0,70 |
| 3,500 % éch. 01/09/2031 | 228 | 208 | 0,01 | | | | | 7,076 % éch. 15/12/2036 | 2 500 | 2 448 | 0,12 |
| 4,150 % éch. 11/10/2025 | 532 | 529 | 0,03 | | | | | Commercial Mortgage Trust | | | |
| 4,150 % éch. 25/02/2033 | 509 | 470 | 0,02 | | | | | 6,658 % éch. 15/09/2033 | 2 800 | 2 530 | 0,12 |
| 5,875 % éch. 15/04/2029 | 5 952 | 6 033 | 0,30 | | | | | Countrywide Alternative Loan Trust | | | |
| Valaris Ltd. | | | | | | | | 5,076 % éch. 25/08/2035 | 951 | 812 | 0,04 |
| 8,375 % éch. 30/04/2030 | 942 | 966 | 0,05 | | | | | 5,892 % éch. 20/03/2046 | 10 | 8 | 0,00 |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC | | | | | | | | 5,930 % éch. 25/03/2036 | 39 | 37 | 0,00 |
| 3,875 % éch. 15/08/2029 | 300 | 273 | 0,01 | | | | | 5,970 % éch. 25/12/2046 | 1 944 | 1 594 | 0,08 |
| 4,125 % éch. 15/08/2031 | 300 | 265 | 0,01 | | | | | 6,030 % éch. 25/08/2035 | 348 | 318 | 0,02 |
| Venture Global LNG, Inc. | | | | | | | | 6,250 % éch. 25/04/2037 | 1 477 | 746 | 0,04 |
| 8,125 % éch. 01/06/2028 | 900 | 910 | 0,04 | | | | | 6,250 % éch. 25/08/2037 | 206 | 102 | 0,01 |
| 8,375 % éch. 01/06/2031 | 900 | 901 | 0,04 | | | | | 6,512 % éch. 25/11/2035 | 5 | 5 | 0,00 |
| 9,500 % éch. 01/02/2029 | 3 900 | 4 129 | 0,20 | | | | | 7,052 % éch. 25/11/2035 | 5 | 5 | 0,00 |
| 9,875 % éch. 01/02/2032 | 1 300 | 1 355 | 0,07 | | | | | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust | | | |
| Windstream Escrow LLC | | | | | | | | 5,810 % éch. 25/06/2035 | 154 | 144 | 0,01 |
| 7,750 % éch. 15/08/2028 | 2 373 | 2 081 | 0,10 | | | | | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust | | | |
| | | 124 953 | 6,15 | | | | | 6,000 % éch. 25/04/2036 | 2 381 | 641 | 0,03 |
| | | | | | | | | Credit Suisse Mortgage Capital Trust | | | |
| | | | | | | | | 7,344 % éch. 15/07/2032 | 15 277 | 14 054 | 0,69 |
| | | | | | | | | Dutch Property Finance BV | | | |
| | | | | | | | | 4,852 % éch. 28/04/2064 | € 11 756 | 13 022 | 0,64 |
| | | | | | | | | EMF-UK PLC | | | |
| | | | | | | | | 7,159 % éch. 13/03/2046 | £ 5 248 | 6 500 | 0,32 |
| | | | | | | | | Eurosail PLC | | | |
| | | | | | | | | 4,419 % éch. 10/09/2044 | € 1 400 | 1 500 | 0,07 |
| | | | | | | | | 5,599 % éch. 10/06/2044 | £ 293 | 372 | 0,02 |
| | | | | | | | | Glenbeigh Issuer DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,666 % éch. 24/06/2050 | € 6 153 | 6 793 | 0,33 |
| | | | | | | | | GreenPoint Mortgage Funding Trust | | | |
| | | | | | | | | 5,870 % éch. 25/05/2037 | \$ 1 744 | 1 638 | 0,08 |
| | | | | | | | | GS Mortgage Securities Corp. Trust | | | |
| | | | | | | | | 7,773 % éch. 15/07/2025 | 12 240 | 12 033 | 0,59 |
| | | | | | | | | GS Mortgage Securities Trust | | | |
| | | | | | | | | 3,750 % éch. 25/10/2057 | 3 656 | 3 528 | 0,17 |
| | | | | | | | | GSR Mortgage Loan Trust | | | |
| | | | | | | | | 6,000 % éch. 25/05/2037 | 158 | 113 | 0,01 |
| | | | | | | | | HarborView Mortgage Loan Trust | | | |
| | | | | | | | | 5,660 % éch. 19/09/2037 | 1 565 | 1 331 | 0,07 |
| | | | | | | | | Harbour Energy PLC | | | |
| | | | | | | | | 6,020 % éch. 28/01/2054 | £ 3 608 | 4 600 | 0,23 |
| | | | | | | | | 6,120 % éch. 28/01/2054 | 14 047 | 17 788 | 0,88 |
| | | | | | | | | Hilton Orlando Trust | | | |
| | | | | | | | | 6,959 % éch. 15/12/2034 | \$ 7 500 | 7 410 | 0,37 |
| | | | | | | | | HomeBanc Mortgage Trust | | | |
| | | | | | | | | 6,280 % éch. 25/10/2035 | 100 | 88 | 0,00 |
| | | | | | | | | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | |
| | | | | | | | | 6,190 % éch. 25/08/2035 | 419 | 401 | 0,02 |
| | | | | | | | | JPMorgan Alternative Loan Trust | | | |
| | | | | | | | | 6,070 % éch. 25/03/2036 | 2 769 | 2 617 | 0,13 |
| | | | | | | | | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust | | | |
| | | | | | | | | 7,776 % éch. 15/02/2035 | 2 664 | 2 554 | 0,13 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Jupiter Mortgage PLC 6,621 % éch. 20/07/2060 | £ 14 595 | \$ 18 603 | 0,92 | Verus Securitization Trust 1,977 % éch. 25/03/2060 | \$ 35 | \$ 35 | 0,00 | GSAMP Trust 6,190 % éch. 25/11/2035 | \$ 3 000 | \$ 2 433 | 0,12 |
| Kinbane DAC 4,685 % éch. 25/09/2062 | € 15 728 | 17 220 | 0,85 | 3,035 % éch. 25/03/2060 | 100 | 97 | 0,00 | Harvest SBA Loan Trust 7,707 % éch. 25/08/2044 | 133 | 132 | 0,01 |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC 7,070 % éch. 12/06/2057 | £ 4 282 | 5 474 | 0,27 | 3,889 % éch. 25/03/2060 | 200 | 194 | 0,01 | Hayfin Emerald CLO DAC 0,000 % éch. 25/01/2037 (b) | € 7 700 | 8 506 | 0,42 |
| 8,470 % éch. 12/06/2057 | 1 000 | 1 274 | 0,06 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,698 % éch. 25/02/2037 | 672 | 602 | 0,03 | Holland Park CLO DAC 4,912 % éch. 14/11/2032 | 7 650 | 8 358 | 0,41 |
| Lehman Mortgage Trust 6,000 % éch. 25/07/2036 | \$ 127 | 65 | 0,00 | 6,230 % éch. 25/01/2045 | 75 | 73 | 0,00 | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,630 % éch. 25/07/2037 | \$ 370 | 200 | 0,01 |
| Lehman XS Trust 5,870 % éch. 25/08/2046 | 6 931 | 6 331 | 0,31 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 6,000 % éch. 25/04/2037 | 4 294 | 3 422 | 0,17 | 5,670 % éch. 25/07/2037 | 4 959 | 2 681 | 0,13 |
| Luminant Mortgage Trust 3,827 % éch. 25/04/2036 | 3 366 | 2 290 | 0,11 | Wells Fargo Alternative Loan Trust 6,500 % éch. 25/07/2037 | 3 202 | 2 791 | 0,14 | HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,610 % éch. 25/12/2036 | 8 345 | 7 029 | 0,35 |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 6,160 % éch. 25/08/2036 | 2 202 | 2 156 | 0,11 | | | 458 207 | 22,57 | 5,660 % éch. 25/01/2037 | 2 806 | 1 953 | 0,10 |
| Morgan Stanley Capital Trust 7,309 % éch. 15/07/2035 | 7 056 | 6 939 | 0,34 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | Invesco Euro CLO DAC 4,615 % éch. 15/07/2031 | € 8 660 | 9 416 | 0,46 |
| 7,609 % éch. 15/07/2035 | 3 014 | 2 949 | 0,15 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,750 % éch. 25/02/2037 | 5 511 | 2 331 | 0,11 | IXIS Real Estate Capital Trust 5,930 % éch. 25/01/2037 | \$ 3 423 | 1 224 | 0,06 |
| Mortgage Funding PLC 6,439 % éch. 13/03/2046 | £ 4 025 | 5 133 | 0,25 | 5,910 % éch. 25/05/2037 | 12 454 | 2 127 | 0,10 | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,730 % éch. 25/06/2037 | 154 | 154 | 0,01 |
| MortgageIT Trust 5,990 % éch. 25/12/2035 | \$ 14 | 14 | 0,00 | Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass- Through Certificates 7,420 % éch. 25/06/2034 | 1 784 | 1 677 | 0,08 | Lehman XS Trust 5,990 % éch. 25/05/2046 | 1 340 | 1 171 | 0,06 |
| Mortimer BTL PLC 0,000 % éch. 22/12/2056 | £ 6 700 | 8 563 | 0,42 | Amortizing Residential Collateral Trust 6,170 % éch. 25/10/2031 | 164 | 159 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/06/2046 | 49 | 41 | 0,00 |
| 6,670 % éch. 23/06/2053 | 1 000 | 1 243 | 0,06 | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass- Through Certificates 6,235 % éch. 25/10/2035 | 100 | 89 | 0,00 | 7,770 % éch. 25/12/2037 | 1 203 | 1 149 | 0,06 |
| Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 3,790 % éch. 15/11/2032 | \$ 7 453 | 5 546 | 0,27 | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 3,118 % éch. 25/07/2036 | 4 140 | 3 969 | 0,20 | Lockwood Grove CLO Ltd. 7,310 % éch. 25/01/2030 | 2 700 | 2 705 | 0,13 |
| Newgate Funding PLC 5,500 % éch. 15/12/2050 | £ 6 692 | 8 199 | 0,40 | 3,972 % éch. 25/05/2036 | 5 957 | 5 166 | 0,25 | Long Beach Mortgage Loan Trust 5,750 % éch. 25/06/2036 | 450 | 414 | 0,02 |
| PHH Alternative Mortgage Trust 6,000 % éch. 25/02/2037 | \$ 3 505 | 2 807 | 0,14 | Auto ABS Spanish Loans 6,365 % éch. 28/02/2032 | € 2 148 | 2 341 | 0,12 | 6,070 % éch. 25/01/2036 | 2 923 | 2 726 | 0,13 |
| Precise Mortgage Funding PLC 6,126 % éch. 16/10/2056 | £ 596 | 760 | 0,04 | Avoca Static CLO DAC 5,690 % éch. 15/10/2030 | 6 600 | 7 287 | 0,36 | Madison Park Euro Funding DAC 4,765 % éch. 15/07/2032 | € 1 900 | 2 070 | 0,10 |
| Primrose Residential DAC 4,876 % éch. 24/10/2061 | € 3 175 | 3 487 | 0,17 | Bayview Financial Acquisition Trust 5,996 % éch. 28/05/2037 | \$ 1 876 | 1 651 | 0,08 | Man GLG Euro CLO DAC 4,705 % éch. 15/10/2030 | 2 592 | 2 843 | 0,14 |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust 5,830 % éch. 25/07/2036 | \$ 1 217 | 1 138 | 0,06 | Bayview Financial Asset Trust 6,970 % éch. 25/03/2037 | 412 | 421 | 0,02 | 5,779 % éch. 15/10/2036 | 7 600 | 8 415 | 0,41 |
| 5,970 % éch. 25/08/2037 | 371 | 338 | 0,02 | Bosphorus CLO DAC 4,960 % éch. 12/12/2032 | € 694 | 758 | 0,04 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 5,750 % éch. 25/05/2037 | \$ 4 286 | 2 185 | 0,11 |
| Residential Asset Securitization Trust 6,609 % éch. 25/02/2037 | 10 592 | 2 521 | 0,12 | Cairn CLO DAC 4,666 % éch. 25/04/2032 | 8 602 | 9 417 | 0,46 | 5,770 % éch. 25/08/2037 | 268 | 250 | 0,01 |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 6,250 % éch. 25/08/2036 | 1 023 | 829 | 0,04 | Carrington Mortgage Loan Trust 6,460 % éch. 25/06/2035 | \$ 3 208 | 3 146 | 0,15 | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 3,938 % éch. 25/01/2035 | 1 330 | 1 025 | 0,05 |
| RESIMAC Bastille Trust 6,390 % éch. 05/09/2057 | 23 | 23 | 0,00 | CIFC Funding Ltd. 6,640 % éch. 24/04/2031 | 4 482 | 4 482 | 0,22 | 5,670 % éch. 25/05/2037 | 908 | 523 | 0,03 |
| RMAC PLC 0,000 % éch. 15/02/2047 | £ 12 300 | 15 731 | 0,78 | College Avenue Student Loans LLC 4,130 % éch. 26/12/2047 | 18 | 18 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/06/2036 | 1 791 | 1 481 | 0,07 |
| RMAC Securities PLC 5,827 % éch. 12/06/2044 | \$ 3 341 | 3 221 | 0,16 | 6,670 % éch. 26/12/2047 | 18 | 18 | 0,00 | 6,385 % éch. 25/03/2035 | 367 | 366 | 0,02 |
| Shamrock Residential DAC 4,726 % éch. 24/01/2061 | € 20 578 | 22 654 | 1,12 | Countrywide Asset-Backed Certificates 6,670 % éch. 25/10/2035 | 802 | 790 | 0,04 | Nassau Ltd. 6,805 % éch. 15/07/2031 | 10 261 | 10 262 | 0,51 |
| 4,876 % éch. 24/06/2071 | 12 991 | 14 283 | 0,70 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,610 % éch. 25/06/2047 | 1 796 | 1 644 | 0,08 | 6,905 % éch. 15/01/2030 | 6 337 | 6 346 | 0,31 |
| 5,126 % éch. 24/02/2071 | 11 047 | 12 185 | 0,60 | 5,680 % éch. 25/05/2047 | 6 194 | 5 476 | 0,27 | Navient Private Education Loan Trust 4,100 % éch. 16/12/2058 | 600 | 578 | 0,03 |
| Southern Pacific Securities PLC 4,499 % éch. 10/03/2044 | 2 064 | 2 242 | 0,11 | 5,750 % éch. 25/12/2046 | 937 | 876 | 0,04 | Nelnet Student Loan Trust 5,910 % éch. 27/09/2066 | 9 957 | 9 922 | 0,49 |
| Stratton BTL Mortgage Funding PLC 6,221 % éch. 20/01/2054 | £ 3 000 | 3 740 | 0,18 | 5,995 % éch. 25/08/2036 | 467 | 451 | 0,02 | New Century Home Equity Loan Trust 6,190 % éch. 25/10/2035 | 7 174 | 6 897 | 0,34 |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 5,736 % éch. 25/09/2034 | \$ 165 | 156 | 0,01 | 6,670 % éch. 25/11/2035 | 5 000 | 4 548 | 0,22 | NovaStar Mortgage Funding Trust 5,630 % éch. 25/09/2037 | 151 | 149 | 0,01 |
| TBW Mortgage-Backed Trust 5,965 % éch. 25/07/2037 | 111 | 34 | 0,00 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 3,201 % éch. 25/01/2037 | 14 072 | 4 379 | 0,22 | 5,670 % éch. 25/01/2037 | 209 | 74 | 0,00 |
| Temple Quay PLC 6,720 % éch. 24/07/2085 | £ 11 358 | 14 494 | 0,71 | Denali Capital CLO Ltd. 6,705 % éch. 15/04/2031 | 1 549 | 1 548 | 0,08 | 7,045 % éch. 25/12/2034 | 3 190 | 3 039 | 0,15 |
| Thornburg Mortgage Securities Trust 5,876 % éch. 25/12/2042 | \$ 76 | 70 | 0,00 | Edsouth Indenture LLC 6,182 % éch. 25/04/2039 | 2 837 | 2 826 | 0,14 | Oak Hill European Credit Partners DAC 4,723 % éch. 20/01/2032 | € 2 552 | 2 792 | 0,14 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | £ 2 238 | 2 856 | 0,14 | Elevation CLO Ltd. 7,505 % éch. 15/07/2029 | 4 400 | 4 409 | 0,22 | OHA Loan Funding Ltd. 6,764 % éch. 23/07/2031 | \$ 2 989 | 2 988 | 0,15 |
| 6,571 % éch. 20/07/2045 | 1 041 | 1 330 | 0,07 | First Franklin Mortgage Loan Trust 5,875 % éch. 25/04/2036 | 1 000 | 754 | 0,04 | Option One Mortgage Loan Trust 5,720 % éch. 25/03/2037 | 4 852 | 2 365 | 0,12 |
| 6,690 % éch. 20/02/2045 | 1 232 | 1 567 | 0,08 | Fremont Home Loan Trust 5,620 % éch. 25/10/2036 | 1 253 | 506 | 0,02 | 6,235 % éch. 25/08/2035 | 1 750 | 1 673 | 0,08 |
| Tower Bridge Funding PLC 0,000 % éch. 20/01/2066 | 16 000 | 20 432 | 1,01 | Generate Ltd. 7,427 % éch. 20/10/2029 | 0 | 0 | 0,00 | 6,895 % éch. 25/11/2034 | 795 | 801 | 0,04 |
| (b) | | | | Golden Bar Securitisation SRL 6,816 % éch. 22/09/2043 | € 2 000 | 2 239 | 0,11 | Palmer Square European Loan Funding DAC 0,000 % éch. 15/05/2033 | € 7 500 | 8 265 | 0,41 |
| Trinity Square PLC 7,970 % éch. 15/07/2059 | 1 000 | 1 266 | 0,06 | 7,516 % éch. 22/09/2043 | 1 000 | 1 116 | 0,05 | 4,685 % éch. 15/10/2031 | 3 433 | 3 731 | 0,18 |
| Twin Bridges PLC 6,170 % éch. 14/06/2055 | 8 455 | 10 766 | 0,53 | GSA Home Equity Trust 5,850 % éch. 25/03/2036 | \$ 2 337 | 827 | 0,04 | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass- Through Certificates 7,045 % éch. 25/02/2035 | \$ 7 755 | 7 433 | 0,37 |
| 6,432 % éch. 15/05/2056 | 10 900 | 13 925 | 0,69 | 5,970 % éch. 25/08/2036 | 11 082 | 4 241 | 0,21 | People's Choice Home Loan Securities Trust 7,495 % éch. 25/10/2034 | 477 | 389 | 0,02 |
| | | | | | | | | Pretium Mortgage Credit Partners LLC 2,487 % éch. 25/07/2051 | 1 516 | 1 497 | 0,07 |
| | | | | | | | | Renaissance Home Equity Loan Trust 5,580 % éch. 25/11/2036 | 1 235 | 431 | 0,02 |
| | | | | | | | | Residential Asset Mortgage Products Trust 6,550 % éch. 25/03/2035 | 2 000 | 1 944 | 0,10 |

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|---------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 221 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | \$ (225) | \$ 221 | \$ 221 | 0,01 |
| | 5,330 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 68 800 | Billets du Trésor américain 1,500 % échéance 30/11/2028 | (70 176) | 68 800 | 68 800 | 3,39 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (354 242) | \$ 345 484 | \$ 345 864 | 17,02 |

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 126 | \$ (503) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2025 | 22 | 82 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2026 | 23 | 52 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2024 | 29 | 153 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2025 | 22 | 57 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2024 | 35 | 213 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2025 | 20 | 62 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2026 | 21 | 47 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2024 | 26 | 116 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2025 | 17 | 40 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 55 | (252) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 1 578 | (5 860) | (0,29) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 141 | (112) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 16 | (148) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 82 | (929) | (0,04) |
| | | | | \$ (6 982) | (0,34) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (6 982) | (0,34) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Airbus Finance BV | 1,000 % | 20/12/2025 | € 7 600 | \$ 208 | 0,01 |
| Airbus Finance BV | 1,000 | 20/06/2026 | 3 100 | (26) | 0,00 |
| Airbus Finance BV | 1,000 | 20/06/2028 | 200 | 1 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2025 | \$ 700 | 23 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/12/2025 | 2 500 | (12) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 1 500 | (8) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 600 | 10 | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20/12/2024 | 2 600 | (129) | (0,01) |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2025 | 100 | 2 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2026 | 100 | 5 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2027 | 200 | 12 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 4 700 | 46 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2025 | € 2 400 | 294 | 0,02 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/06/2027 | 1 100 | 109 | 0,01 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | \$ 2 200 | 5 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 3 000 | (36) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 400 | (5) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 3 400 | 48 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 900 | 13 | 0,00 |
| | | | | \$ 560 | 0,03 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-31 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 688 | \$ 27 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-32 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2024 | 510 | 25 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-34 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2025 | 1 196 | 23 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-36 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2026 | 9 752 | 373 | 0,02 |
| Indice CDX.EM-38 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2027 | 800 | 56 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-39 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2028 | 500 | 24 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 4 700 | 99 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-36 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/06/2026 | \$ 5 723 | \$ (143) | (0,01) |
| Indice CDX.HY-37 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2026 | 2 231 | 37 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-39 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2027 | 490 | 23 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-40 Index à 5 ans | 5,000 | 20/06/2028 | 297 | 18 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | 48 312 | 2 566 | 0,13 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 2 200 | 14 | 0,00 |
| | | | | \$ 3 142 | 0,15 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,060 % | 21/02/2052 | £ 300 | \$ (168) | (0,01) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,096 | 14/02/2052 | 600 | (331) | (0,02) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,101 | 21/02/2052 | 300 | (165) | (0,01) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,175 | 28/02/2052 | 600 | (319) | (0,02) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 1 700 | (283) | (0,01) |
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 4 500 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/03/2029 | ¥ 8 473 000 | 980 | 0,05 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,176 | 27/04/2027 | 550 000 | (13) | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/06/2032 | 1 467 200 | 270 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 15/03/2042 | 702 000 | 378 | 0,02 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,711 | 27/04/2042 | 130 000 | 79 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2026 | \$ 88 900 | 5 788 | 0,28 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2028 | 10 869 | (951) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,928 | 06/05/2026 | 2 200 | 180 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,940 | 08/06/2026 | 2 900 | 226 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2027 | 3 600 | 254 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2029 | 4 070 | 365 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2030 | 20 713 | 4 081 | 0,20 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,030 | 17/06/2026 | 3 600 | 271 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,235 | 12/05/2028 | 1 100 | 124 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 17/06/2030 | 4 400 | 418 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/06/2032 | 22 690 | (2 362) | (0,12) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/12/2050 | 12 600 | 4 059 | 0,20 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/06/2051 | 8 700 | 2 250 | 0,11 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,317 | 16/12/2050 | 400 | (155) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360 | 15/02/2027 | 6 700 | 535 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360 | 20/07/2031 | 1 400 | 230 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,370 | 19/07/2031 | 900 | 147 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,380 | 04/01/2027 | 3 600 | (288) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,418 | 20/01/2027 | 1 300 | (102) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,425 | 18/01/2027 | 2 500 | (193) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,438 | 22/01/2051 | 9 000 | (3 383) | (0,17) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450 | 17/02/2027 | 6 300 | 484 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450 | 16/07/2031 | 2 000 | 321 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 7 919 | (1 011) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 18/12/2029 | 1 200 | 110 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 17/06/2050 | 7 700 | 3 955 | 0,19 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,518 | 20/01/2029 | 800 | (86) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,570 | 12/01/2027 | 1 400 | (103) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,580 | 16/02/2027 | 2 800 | (195) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,580 | 13/01/2051 | 9 300 | (3 328) | (0,16) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,600 | 16/01/2026 | 17 200 | 575 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,600 | 15/02/2027 | 26 800 | (1 836) | (0,09) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,625 | 06/01/2030 | 300 | 41 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,630 | 26/01/2029 | 1 300 | (131) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 06/03/2024 | 6 400 | (31) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 17/02/2027 | 25 000 | (1 620) | (0,08) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,730 | 24/02/2032 | 1 600 | (238) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2025 | 38 000 | 1 123 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2029 | 3 538 | 157 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/01/2030 | 4 600 | 575 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 1 608 | 75 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2052 | 28 100 | 5 008 | 0,25 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,765 | 16/03/2032 | 600 | (86) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,783 | 22/04/2027 | 2 100 | (169) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,785 | 12/08/2051 | 1 100 | 373 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,788 | 03/05/2027 | 2 300 | (184) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,815 | 24/01/2052 | 300 | (95) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,867 | 26/01/2052 | 300 | (91) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,910 | 17/10/2049 | 400 | 130 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,988 | 09/02/2032 | 1 100 | 129 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2027 | 2 100 | (26) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 10/12/2029 | 21 000 | 2 266 | 0,11 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2029 | 11 170 | (222) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 12/02/2030 | 2 500 | 286 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 10/03/2030 | 1 200 | 115 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2032 | 17 930 | 22 | 0,00 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/(moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,008 % | 09/02/2032 | \$ 1 900 | \$ 223 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250 | 12/03/2050 | 15 700 | 3 781 | 0,19 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,300 | 17/01/2026 | 12 300 | 401 | 0,02 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,350 | 17/01/2025 | 21 900 | 494 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,385 | 08/06/2032 | 1 400 | 119 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,436 | 08/06/2032 | 6 800 | 557 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 20/12/2024 | 43 700 | 1 020 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 04/10/2027 | 5 430 | 264 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,451 | 08/06/2032 | 8 700 | 703 | 0,03 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,468 | 27/07/2028 | 1 500 | (52) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,537 | 24/07/2053 | 400 | (34) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,543 | 05/02/2024 | 1 000 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,550 | 05/02/2024 | 1 000 | 2 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,550 | 21/07/2053 | 400 | (33) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,559 | 05/02/2024 | 1 000 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,571 | 05/02/2024 | 500 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,580 | 05/02/2024 | 1 500 | 3 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,605 | 05/02/2024 | 1 500 | 3 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,607 | 05/02/2024 | 500 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,675 | 24/07/2028 | 1 500 | (39) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,700 | 21/07/2028 | 1 500 | (37) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,765 | 27/07/2024 | 6 900 | (131) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 3 800 | (55) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,900 | 04/10/2027 | 15 500 | (380) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 3 700 | (50) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 9 600 | (144) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 3 900 | (52) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | 4 400 | (61) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 19/06/2024 | 24 000 | 1 062 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 19/06/2026 | 12 700 | 839 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2030 | 85 750 | 3 199 | 0,16 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 7 110 | 281 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 270 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 3 900 | (52) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 21/07/2024 | 6 900 | (114) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 07/09/2027 | 1 400 | (32) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 06/09/2032 | 2 000 | (60) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,052 | 24/07/2024 | 6 900 | (112) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,080 | 23/02/2053 | 1 200 | (65) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 3 800 | (44) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 3 900 | (45) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 3 900 | (44) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 3 900 | (43) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 43 820 | 1 043 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 06/03/2033 | 2 000 | (52) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,350 | 14/12/2032 | 500 | 7 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 01/03/2033 | 2 000 | (38) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 12/07/2053 | 2 800 | 18 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400 | 23/02/2033 | 3 200 | (53) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,405 | 01/03/2033 | 2 100 | (34) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,420 | 24/05/2033 | 7 600 | (88) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430 | 27/02/2033 | 2 100 | (30) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450 | 07/03/2033 | 3 900 | (49) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 21/06/2026 | 6 720 | 144 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 45 820 | (539) | (0,03) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/05/2033 | 29 710 | (388) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 21/06/2033 | 8 100 | (23) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 1 900 | (58) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 600 | 42 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,610 | 12/12/2032 | 1 100 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 7 200 | (66) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 6 000 | (54) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 10/07/2033 | 4 600 | 44 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 1 300 | (18) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700 | 06/06/2033 | 66 350 | (62) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730 | 03/08/2033 | 1 400 | 25 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735 | 07/08/2033 | 1 600 | 30 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 7 200 | (58) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 6 100 | (47) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 51 850 | (507) | (0,03) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 15 400 | (8) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2031 | 85 900 | 14 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 12/07/2033 | 4 000 | 74 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 1 300 | (26) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 2 000 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 1 200 | 19 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 1 300 | (32) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 2 600 | (73) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 30/08/2033 | 2 400 | 81 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 2 900 | (104) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 4 900 | 227 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 % | 15/12/2033 | \$ 2 600 | \$ (109) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,040 | 20/06/2024 | 7 900 | (61) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060 | 20/06/2024 | 31 700 | (240) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,140 | 22/06/2024 | 13 200 | (89) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 2 400 | 138 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 2 400 | 142 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200 | 18/10/2033 | 2 000 | 123 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 2 400 | 152 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 | 23/10/2033 | 1 300 | 84 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2029 | 2 100 | (9) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2031 | 4 210 | (24) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 2 600 | (154) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255 | 23/10/2033 | 1 300 | 86 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393 | 25/10/2033 | 1 200 | 94 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 1 300 | 107 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 2 600 | 218 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 22/05/2025 | 65 120 | 145 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,900 | 06/06/2025 | 144 940 | 304 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,100 | 22/05/2024 | 125 980 | 57 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,400 | 06/06/2024 | 281 160 | 300 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,874 | 02/01/2026 | BRL 8 000 | (6) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,899 | 02/01/2026 | 4 000 | (3) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,939 | 02/01/2026 | 6 300 | (3) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,998 | 04/01/2027 | 12 000 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,037 | 04/01/2027 | 2 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,041 | 04/01/2027 | 11 300 | 1 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,052 | 02/01/2026 | 13 900 | (2) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,085 | 02/01/2026 | 13 700 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,090 | 04/01/2027 | 21 200 | 7 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,105 | 02/01/2026 | 13 600 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,138 | 04/01/2027 | 5 300 | 3 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,157 | 02/01/2025 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,177 | 02/01/2025 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,250 | 04/01/2027 | 200 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,275 | 04/01/2027 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,290 | 04/01/2027 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,367 | 02/01/2025 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,746 | 04/01/2027 | 200 | 1 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,901 | 04/01/2027 | 500 | 3 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,018 | 02/01/2025 | 300 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,047 | 04/01/2027 | 57 400 | 419 | 0,02 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,098 | 02/01/2025 | 500 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,158 | 02/01/2025 | 300 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,163 | 02/01/2025 | 300 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,178 | 02/01/2025 | 500 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,360 | 07/08/2028 | ZAR 37 400 | 33 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,380 | 04/08/2028 | 35 400 | 33 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 31/07/2028 | 24 200 | 24 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 07/08/2028 | 5 500 | 5 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,415 | 31/07/2028 | 6 500 | 7 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,415 | 04/08/2028 | 9 000 | 9 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,420 | 31/07/2028 | 24 200 | 24 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,421 | 04/08/2028 | 12 400 | 13 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,426 | 01/08/2028 | 9 800 | 10 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,460 | 01/08/2028 | 16 500 | 18 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,460 | 02/08/2028 | 16 700 | 18 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,543 | 04/08/2028 | 9 100 | 12 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,550 | 03/08/2028 | 19 800 | 26 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 3,000 | 21/03/2027 | AUD 12 400 | (526) | (0,03) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | 6 500 | 130 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,250 | 18/03/2050 | € 2 500 | 1 030 | 0,05 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,294 | 30/06/2026 | 100 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,329 | 30/12/2025 | 200 | 13 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,363 | 30/06/2025 | 300 | 17 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,395 | 30/12/2024 | 200 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,425 | 28/06/2024 | 300 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,500 | 17/06/2050 | 600 | 262 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | 2 400 | (80) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 11/05/2027 | 14 200 | (857) | (0,04) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,700 | 11/04/2027 | 4 800 | (304) | (0,02) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,830 | 09/12/2052 | 27 100 | 1 437 | 0,07 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 9 800 | (488) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 18/05/2027 | 4 700 | (231) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,750 | 21/09/2027 | 3 500 | (121) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | 9 900 | 25 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 15 000 | 41 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 8 600 | 26 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 26/04/2024 | 9 900 | 54 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 9 200 | 43 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 9 600 | 44 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | 4 900 | 186 | 0,01 |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 % | 03/01/2029 | € 2 100 | \$ (31) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 3 000 | (61) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 2 400 | (82) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 1 600 | (59) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 3 700 | (81) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 2 100 | (91) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 11 800 | (742) | (0,04) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 1 600 | (80) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,128 | 04/12/2033 | 1 200 | (67) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 1 900 | (109) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 1 600 | (54) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 16 100 | (10) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 06/11/2033 | 1 900 | (125) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 1 500 | (56) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 08/11/2028 | 3 100 | (116) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 21/08/2033 | 1 600 | 120 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 1 000 | (70) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 2 000 | (145) | (0,01) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,450 | 20/10/2028 | 2 900 | 144 | 0,01 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,300 | 16/06/2028 | MXN 23 100 | (8) | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,444 | 25/07/2028 | 53 000 | (24) | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,471 | 26/07/2028 | 26 700 | (10) | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,512 | 24/07/2028 | 40 100 | (12) | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,550 | 27/07/2028 | 13 500 | (3) | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,556 | 27/07/2028 | 80 500 | (16) | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,600 | 31/07/2028 | 24 400 | (1) | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,620 | 28/07/2028 | 14 500 | (1) | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,636 | 28/07/2028 | 29 000 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,640 | 28/07/2028 | 5 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,650 | 28/07/2028 | 14 700 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIIIE MXN à 28 jours | 8,660 | 28/07/2028 | 14 500 | 1 | 0,00 |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,000 | 15/09/2031 | £ 900 | (135) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,020 | 15/10/2031 | 1 200 | (171) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,055 | 15/09/2031 | 800 | (118) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,066 | 15/09/2031 | 1 700 | (220) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,140 | 15/10/2031 | 2 300 | (289) | (0,01) |
| | | | | | \$ 28 756 | 1,42 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 32 458 | 1,60 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

| OPTIONS ACHETÉES | | | | | | | | | |
|-----------------------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT | | | | | | | | | |
| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,110 % | 26/07/2032 | 1 100 | \$ 178 | \$ 110 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,110 | 26/07/2032 | 1 600 | 259 | 356 | 0,02 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,620 | 22/07/2024 | 15 900 | 119 | 14 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,620 | 22/07/2024 | 15 900 | 119 | 200 | 0,01 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,590 | 19/07/2024 | 11 300 | 156 | 30 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,590 | 19/07/2024 | 11 300 | 156 | 218 | 0,01 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,170 | 19/07/2032 | 1 200 | 190 | 123 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,170 | 19/07/2032 | 1 400 | 222 | 303 | 0,01 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,400 | 20/07/2027 | 1 200 | 158 | 78 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,400 | 20/07/2027 | 1 400 | 185 | 268 | 0,01 |
| | | | | | | | \$ 1 742 | \$ 1 700 | 0,08 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTERET

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 800 | \$ (3) | \$ (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 800 | (3) | (2) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 1 500 | (7) | (11) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 2 800 | (13) | (35) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 1 500 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 2 800 | (13) | (1) | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,690 | 02/04/2024 | 2 100 | (17) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,690 | 02/04/2024 | 2 100 | (17) | (34) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 2 600 | (11) | (8) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 2 600 | (11) | (8) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 1 100 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 1 900 | (7) | (21) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 1 100 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 1 900 | (7) | 0 | 0,00 |
| DUB | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,790 | 08/04/2024 | 3 300 | (25) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,790 | 08/04/2024 | 3 300 | (25) | (49) | (0,01) |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 12 300 | (96) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 12 300 | (96) | (196) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 | 08/04/2024 | 4 100 | (31) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 4 100 | (31) | (63) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 2 600 | (11) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 1 300 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 2 600 | (11) | (9) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 2 800 | (14) | (30) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 2 800 | (14) | (36) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 2 700 | (12) | (44) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 2 600 | (11) | (8) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 1 300 | (5) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 2 600 | (11) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 2 800 | (14) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 2 800 | (14) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 3 000 | (7) | (11) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 3 000 | (7) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 2 900 | (14) | (16) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 1 500 | (7) | (10) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 1 400 | (6) | (22) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 2 900 | (14) | (52) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 2 900 | (14) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 1 500 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 1 400 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 2 900 | (14) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 1 800 | (8) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 1 800 | (8) | (3) | 0,00 |
| UAG | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 1 400 | (7) | (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 1 400 | (7) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (676) | \$ (718) | (0,04) |

OPTIONS À TAUX D'INTERET PLAFONNEES

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| MYC | Option d'achat - Taux d'intérêt plafonné à 1 an hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 1 an | 0,026 % | 23/07/2025 | 15 900 | \$ (139) | \$ (217) | (0,01) |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 1 an | 0,030 | 24/07/2024 | 31 800 | (127) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 1 an | 0,026 | 23/07/2025 | 15 900 | (139) | (32) | 0,00 |
| | Option d'achat - Taux d'intérêt plafonné à 2 ans hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 2 ans | 0,026 | 23/07/2026 | 11 300 | (200) | (266) | (0,01) |
| | Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote ⁽²⁾ | LIBOR USD à 2 ans | 0,026 | 23/07/2026 | 11 300 | (200) | (75) | (0,01) |
| | | | | | | \$ (805) | \$ (591) | (0,03) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

⁽²⁾ Cet instrument sous-jacent a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | \$ 97,891 | 09/01/2024 | 6 000 | \$ (24) | \$ (68) | (0,01) |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 101,094 | 06/02/2024 | 4 500 | (18) | (36) | 0,00 |
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 95,813 | 06/02/2024 | 6 500 | (36) | (29) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 97,813 | 06/02/2024 | 6 500 | (34) | (35) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | 98,469 | 09/01/2024 | 5 500 | (25) | (37) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | 99,906 | 09/01/2024 | 3 000 | (8) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2054 | 96,813 | 06/02/2024 | 5 000 | (13) | (9) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2054 | 100,813 | 06/02/2024 | 5 000 | (8) | (9) | 0,00 |
| | | | | | \$ (166) | \$ (225) | (0,01) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--------------|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 % | 20/12/2024 | \$ 100 | \$ (12) | \$ 12 | \$ 0 | 0,00 | |
| BPS | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 500 | (45) | 42 | (3) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 100 | (2) | 3 | 1 | 0,00 | |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2026 | 900 | (41) | 46 | 5 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 640 | (82) | 85 | 3 | 0,00 | |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 400 | (14) | 14 | 0 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 100 | (2) | 3 | 1 | 0,00 | |
| DUB | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 100 | (4) | 3 | (1) | 0,00 | |
| GST | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 500 | (18) | 18 | 0 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 300 | (27) | 25 | (2) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2025 | 200 | (11) | 12 | 1 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 700 | (79) | 82 | 3 | 0,00 | |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 700 | (27) | 28 | 1 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 800 | (71) | 67 | (4) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 300 | (2) | 5 | 3 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2025 | 200 | (3) | 6 | 3 | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/12/2026 | 1 400 | (62) | 54 | (8) | 0,00 | |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 100 | (16) | 16 | 0 | 0,00 | |
| | | | | | | \$ (518) | \$ 521 | \$ 3 | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|--------|
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 % | 16/12/2072 | \$ 62 300 | \$ 92 | \$ (510) | \$ (418) | (0,02) | |
| MEI | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 15 300 | (74) | 14 | (60) | 0,00 | |
| MYC | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 25 375 | (78) | 76 | (2) | 0,00 | |
| | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18/11/2054 | 25 375 | (193) | 150 | (43) | 0,00 | |
| | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 300 | (2) | 1 | (1) | 0,00 | |
| | Indice CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16/12/2072 | 25 500 | 86 | (257) | (171) | (0,01) | |
| | | | | | | \$ (169) | \$ (526) | \$ (695) | (0,03) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 1 037 | \$ 686 | \$ 0 | \$ (21) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 18 809 | 2 610 | 0 | (47) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | AUD | 550 | 364 | 0 | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 7 695 | 9 766 | 0 | (43) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 8 279 | ¥ 1 221 692 | 393 | 0 | 0,02 |
| | 01/2024 | | 102 | MXN 1 738 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 148 | ZAR 2 759 | 3 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 2 262 | \$ 118 | 0 | (6) | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY | 6 029 | 834 | 0 | (18) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 30 126 | 4 162 | 0 | (94) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR | 21 414 380 | 1 375 | 0 | (13) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 83 855 | 2 721 | 0 | (57) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 113 | IDR 1 757 648 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 431 | INR 119 737 | 3 | 3 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 583 207 | \$ 448 | 0 | (6) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | BRL | 32 340 | 6 700 | 42 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 50 157 | 37 013 | 0 | (1 026) | (0,05) |
| | 01/2024 | € | 1 804 | 1 962 | 0 | (31) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 24 604 | 31 209 | 0 | (158) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF | 474 002 | 1 349 | 0 | (21) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 457 205 | 350 | 0 | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | TWD | 18 785 | 600 | 0 | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 100 | BRL 491 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 683 | € 4 215 | 0 | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 230 | £ 968 | 4 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 | HUF 432 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 350 | IDR 5 413 713 | 1 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 6 970 | ¥ 1 007 700 | 182 | 0 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 152 | KRW 196 166 | 0 | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 326 | ZAR 43 014 | 23 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 98 857 | \$ 3 106 | 0 | (161) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH | 18 321 | 2 546 | 0 | (42) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | SGD 225 | \$ 169 | \$ 0 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 304 000 | 9 745 | 0 | (328) | (328) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 51 | CNH 367 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 415 | IDR 21 699 020 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | 4 972 | INR 415 903 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 04/2024 | 6 700 | BRL 32 666 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 3 742 792 | \$ 2 868 | 1 | (46) | (45) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | CAD 1 037 | 775 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 241 771 | 265 895 | 0 | (1 239) | (1 239) | (0,06) |
| | 01/2024 | \$ 5 973 | BRL 29 189 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 01/2024 | 593 | CLP 513 365 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 597 | MXN 27 248 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 408 | TRY 42 231 | 3 | (2) | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 609 | TWD 18 685 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | 347 | ZAR 6 470 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 2 220 000 | \$ 14 948 | 0 | (921) | (921) | (0,05) |
| | 02/2024 | TRY 70 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD 9 810 | 311 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 1 443 | TRY 44 001 | 2 | (7) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ 2 613 000 | \$ 18 516 | 0 | (238) | (238) | (0,01) |
| | 03/2024 | TWD 18 476 | 609 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 251 | IDR 3 896 602 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 861 | TRY 90 172 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 04/2024 | ¥ 391 000 | \$ 2 792 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ 6 146 | TRY 198 090 | 0 | (88) | (88) | (0,01) |
| | 06/2024 | KRW 4 402 849 | \$ 3 397 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | BRL 4 918 | 994 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 280 160 | 800 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR 4 628 561 | 301 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 452 449 | 350 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 165 156 | 9 242 | 0 | (467) | (467) | (0,02) |
| | 01/2024 | TRY 85 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 442 | £ 1 929 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 01/2024 | 400 | IDR 6 151 800 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 527 | MXN 9 236 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 01/2024 | 119 | ZAR 2 184 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 42 252 | \$ 2 221 | 0 | (87) | (87) | (0,01) |
| | 03/2024 | PEN 2 138 | 568 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 301 | IDR 4 629 749 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | ¥ 300 000 | \$ 2 142 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | CAD 220 209 | 166 249 | 0 | (756) | (756) | (0,04) |
| | 01/2024 | \$ 2 209 | TRY 65 703 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 754 | BRL 18 413 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 21 091 | \$ 2 927 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 798 | IDR 12 305 576 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| GLM | 06/2024 | KRW 2 397 176 | \$ 1 842 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 41 118 | 30 369 | 0 | (818) | (818) | (0,04) |
| | 01/2024 | ¥ 102 200 | 717 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 530 | BRL 7 687 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 985 | ¥ 585 977 | 174 | 0 | 174 | 0,01 |
| | 01/2024 | 8 490 | MXN 148 897 | 263 | 0 | 263 | 0,01 |
| | 01/2024 | 1 058 | TRY 32 294 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 02/2024 | TRY 118 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 27 995 | BRL 142 984 | 1 394 | 0 | 1 394 | 0,07 |
| | 03/2024 | CNH 8 192 | \$ 1 135 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 3 133 789 | 196 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 619 | IDR 9 529 922 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | 713 | TRY 22 399 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | AUD 486 | \$ 322 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 9 441 | 10 293 | 0 | (139) | (139) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 5 136 | 6 469 | 0 | (78) | (78) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 52 688 | 150 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 885 | TRY 26 325 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 150 | ZAR 2 869 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 6 562 | \$ 346 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ 120 000 | 811 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 12 823 | 1 794 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNY 26 417 | 3 734 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 601 | IDR 9 270 880 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | CAD 379 | \$ 283 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 807 | 895 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 141 197 | 401 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD 802 | 609 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY 135 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 307 | € 276 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 402 | £ 1 910 | 34 | (1) | 33 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 366 | ¥ 643 482 | 202 | 0 | 202 | 0,01 |
| | 01/2024 | 1 619 | ZAR 29 838 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 3 734 | \$ 196 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 5 | TRY 139 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 17 949 | \$ 2 489 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 03/2024 | ¥ 510 000 | 3 505 | 0 | (149) | (149) | (0,01) |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | \$ 4 248 | IDR 65 422 444 | \$ 3 | \$ (8) | \$ (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 823 | TRY 88 122 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 1 403 919 | \$ 1 079 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| RBC | 04/2024 | \$ 12 | MXN 209 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | ZAR 9 687 | \$ 511 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 17 621 | 2 434 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 25 426 647 | 1 639 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 41 735 | 1 322 | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 596 | IDR 9 330 941 | 10 | (1) | 9 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 633 | INR 220 157 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SSB | 06/2024 | KRW 1 886 067 | \$ 1 453 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 1 004 | IDR 15 504 391 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 579 | INR 131 759 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 133 600 | \$ 169 075 | 0 | (1 243) | (1 243) | (0,06) |
| | 01/2024 | ¥ 285 000 | 1 933 | 0 | (94) | (94) | (0,01) |
| | 01/2024 | MXN 9 766 | 552 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY 4 891 | 166 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 24 719 | 1 295 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 166 | TRY 5 044 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | \$ 2 958 | \$ (9 300) | \$ (6 342) | (0,31) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ 23 237 | CHF 20 258 | \$ 845 | \$ 0 | \$ 845 | 0,04 |
| CBK | 01/2024 | 23 128 | 20 150 | 825 | 0 | 825 | 0,04 |
| MYI | 01/2024 | 23 016 | 20 091 | 868 | 0 | 868 | 0,04 |
| | | | | \$ 2 538 | \$ 0 | \$ 2 538 | 0,12 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 710 | \$ 1 890 | \$ 1 | \$ (1) | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 302 253 | € 274 773 | 1 349 | (3) | 1 346 | 0,07 |
| BRC | 01/2024 | 290 486 | 264 131 | 1 353 | 0 | 1 353 | 0,07 |
| CBK | 01/2024 | € 544 | \$ 586 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 447 | € 406 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 1 391 | \$ 1 520 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 301 | € 276 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | € 380 | \$ 411 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 290 534 | € 264 131 | 1 305 | 0 | 1 305 | 0,06 |
| | | | | \$ 4 014 | \$ (44) | \$ 3 970 | 0,20 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 19 122 | £ 15 084 | \$ 108 | \$ 0 | \$ 108 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | 27 271 | 21 500 | 138 | 0 | 138 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 507 | 401 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 2 142 | \$ 2 712 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 13 | £ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 470 | \$ 598 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 2 200 | 2 810 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 | £ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| NGF | 01/2024 | £ 38 860 | \$ 49 200 | 0 | (341) | (341) | (0,02) |
| SCX | 01/2024 | \$ 156 157 | £ 123 456 | 1 230 | 0 | 1 230 | 0,06 |
| SSB | 01/2024 | 109 836 | 87 043 | 1 130 | 0 | 1 130 | 0,05 |
| UAG | 01/2024 | 156 132 | 123 369 | 1 145 | 0 | 1 145 | 0,06 |
| | | | | \$ 3 760 | \$ (361) | \$ 3 399 | 0,17 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|------|
| BOA | 01/2024 | \$ | 4 229 | SGD 5 642 | \$ 49 | \$ 0 | 49 | 0,01 |
| DUB | 01/2024 | | 4 386 | 5 830 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SGD | 148 | \$ 111 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 369 | SGD 492 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD | 95 | \$ 71 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 437 | SGD 583 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 79 | 105 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | | 3 959 | 5 281 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 437 | 576 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | | 448 | 595 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | | \$ 144 | \$ (2) | \$ 142 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ 3 181 | 0,16 | |

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/03/2054 | \$ 5 800 | \$ (5 624) | (0,28) |
| Total des Titres vendus à découvert | \$ (5 624) | (0,28) | |
| Total des Investissements | \$ 3 259 599 | 160,55 | |
| Autres actifs et passifs à court terme | \$ (1 229 294) | (60,55) | |
| Actifs nets | \$ 2 030 305 | 100,00 | |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

- * Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.
- ^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.
- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre vendu avant l'émission.
- (c) Titre à rémunération en nature.
- (d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
- (e) Titre à coupon zéro.
- (f) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (g) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (h) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (i) Affilié au Fonds.
- (j) Titre convertible conditionnel.
- (k) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,77 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|----------|--------------|---------------------|
| AMSURG Corp. | 02/11/2023 - 06/11/2023 | \$ 1 905 | \$ 2 338 | 0,11 |
| Intelsat Emergence S.A. | 05/09/2018 - 23/02/2022 | 3 227 | 1 299 | 0,06 |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC | 25/09/2020 | 166 | 771 | 0,04 |
| Westmoreland Mining Holdings LLC | 26/03/2019 | 0 | 0 | 0,00 |
| Westmoreland Mining LLC | 07/03/2023 | 1 | 1 | 0,00 |
| | | \$ 5 299 | \$ 4 409 | 0,21 |

Un montant en numéraire de 1 587 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 42 633 \$ (31 décembre 2022 : 24 006 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 2 797 \$ (31 décembre 2022 : 9 984 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 516 | \$ 2 665 094 | \$ 26 471 | \$ 2 692 081 |
| Fonds d'investissement | 199 001 | 0 | 0 | 199 001 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 345 484 | 0 | 345 484 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (252) | 28 909 | 0 | 28 657 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (5 624) | 0 | (5 624) |
| Totaux | \$ 199 265 | \$ 3 033 863 | \$ 26 471 | \$ 3 259 599 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 1 018 | \$ 1 197 881 | \$ 14 709 | \$ 1 213 608 |
| Fonds d'investissement | 106 140 | 0 | 0 | 106 140 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 98 831 | 0 | 98 831 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 579 | 14 698 | 0 | 15 277 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (5 209) | 0 | (5 209) |
| Totaux | \$ 107 737 | \$ 1 306 201 | \$ 14 709 | \$ 1 428 647 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (68) | \$ 0 | \$ (68) | \$ (35) | \$ 0 | \$ (35) |
| BOA | 199 | 0 | 199 | (2 834) | 2 820 | (14) |
| BPS | (200) | (1 560) | (1 760) | (1 952) | 1 730 | (222) |
| BRC | (343) | 90 | (253) | (307) | 301 | (6) |
| CBK | 144 | (290) | (146) | 6 696 | (6 666) | 30 |
| DUB | (832) | 530 | (302) | (582) | 370 | (212) |
| GLM | 1 092 | (760) | 332 | (2 097) | 2 036 | (61) |
| GST | (427) | 554 | 127 | (885) | 904 | 19 |
| HUS | S/O | S/O | S/O | 1 | 0 | 1 |
| MBC | (312) | 260 | (52) | 4 371 | (3 930) | 441 |
| MEI | (60) | 280 | 220 | (56) | 260 | 204 |
| MYC | 313 | 583 | 896 | (562) | 813 | 251 |
| MYI | 891 | (810) | 81 | (223) | 270 | 47 |
| NGF | (341) | 500 | 159 | S/O | S/O | S/O |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (39) | 0 | (39) |
| SAL | (121) | 0 | (121) | (49) | 0 | (49) |
| SCX | 1 085 | (1 600) | (515) | 6 363 | (5 950) | 413 |
| SSB | 1 131 | (980) | 151 | 16 | 0 | 16 |
| UAG | 1 030 | (2 580) | (1 550) | (687) | 480 | (207) |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 44,20 | 35,07 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 87,13 | 75,51 |
| Autres valeurs mobilières | 1,26 | 1,33 |
| Fonds d'investissement | 9,80 | 9,79 |
| Contrats de mise en pension | 17,02 | 9,11 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,34) | 0,19 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 1,60 | 0,57 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,16 | 0,66 |
| Titres vendus à découvert | (0,28) | (0,48) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 1,67 | 6,41 |
| Obligations et billets privés | 20,46 | 26,11 |
| Obligations et billets convertibles | 0,03 | 0,05 |
| Agences du gouvernement américain | 59,41 | 33,41 |
| Obligations du Trésor américain | 9,00 | 9,02 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 22,57 | 19,47 |
| Titres adossés à des actifs | 13,88 | 8,93 |
| Émissions souveraines | 2,94 | 3,00 |
| Actions ordinaires | 0,25 | 0,29 |
| Droits | S/O | 0,01 |
| Bons de souscription | 0,00 | 0,00 |
| Sociétés d'investissement immobilier | 0,00 | 0,00 |
| Instruments à court terme | 2,38 | 5,21 |
| Fonds d'investissement | 9,80 | 9,79 |
| Contrats de mise en pension | 17,02 | 9,11 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,34) | 0,20 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,03 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,15 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 1,42 | 0,57 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,08 | 0,19 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,04) | (0,32) |
| Options à taux d'intérêt plafonnées | (0,03) | (0,08) |
| Options sur titres | (0,01) | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,04) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | (0,03) | (0,13) |
| Swaps de rendement total sur indices | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,31) | (0,55) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,50 | 1,60 |
| Titres vendus à découvert | (0,28) | (0,48) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (60,55) | (31,75) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------|
| Haleon UK Capital PLC 3,125 % éch. 24/03/2025 | \$ 2 000 | \$ 1 954 | 0,25 | 5,625 % éch. 26/08/2028 | \$ 1 100 | \$ 1 019 | 0,13 | 2,125 % éch. 30/09/2024 | \$ 17 000 | \$ 16 652 | 2,11 | |
| Humana, Inc. 3,700 % éch. 23/03/2029 | 2 000 | 1 922 | 0,24 | | | 69 673 | 8,85 | 2,375 % éch. 15/08/2024 | 550 | 541 | 0,07 | |
| Informa PLC 1,250 % éch. 22/04/2028 | € 1 500 | 1 519 | 0,19 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | |
| InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % éch. 24/08/2026 | £ 200 | 237 | 0,03 | AES Corp. 2,450 % éch. 15/01/2031 | 3 000 | 2 522 | 0,32 | Adjustable Rate Mortgage Trust 4,515 % éch. 25/11/2035 | 264 | 185 | 0,02 | |
| 2,125 % éch. 15/05/2027 | € 700 | 747 | 0,10 | 5,450 % éch. 01/06/2028 | 2 000 | 2 035 | 0,26 | American Home Mortgage Investment Trust 6,050 % éch. 25/11/2045 | 1 309 | 1 136 | 0,14 | |
| John Lewis PLC 4,250 % éch. 18/12/2034 | £ 1 300 | 1 206 | 0,15 | Duke Energy Progress LLC 5,250 % éch. 15/03/2033 | 2 000 | 2 063 | 0,26 | Atlas Funding PLC 6,120 % éch. 25/07/2058 | £ 748 | 954 | 0,12 | |
| 6,125 % éch. 21/01/2025 | 350 | 445 | 0,06 | Électricité de France S.A. 3,000 % éch. 03/09/2027 | € 800 | 808 | 0,10 | Banc of America Funding Trust 5,792 % éch. 20/02/2047 | \$ 585 | 599 | 0,08 | |
| Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % éch. 21/07/2028 | \$ 200 | 185 | 0,02 | (f) | € 800 | 808 | 0,10 | 5,852 % éch. 20/07/2036 | 884 | 864 | 0,11 | |
| MGM China Holdings Ltd. 5,250 % éch. 18/06/2025 | 200 | 197 | 0,03 | Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % éch. 01/01/2026 | \$ 1 300 | 1 247 | 0,16 | 6,412 % éch. 25/10/2036 | 8 | 6 | 0,00 | |
| 5,875 % éch. 15/05/2026 | 200 | 196 | 0,03 | 3,450 % éch. 01/07/2025 | 200 | 194 | 0,02 | Barley Hill PLC 6,118 % éch. 27/08/2058 | £ 1 984 | 2 521 | 0,32 | |
| Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % éch. 20/06/2027 | 81 | 81 | 0,01 | 3,500 % éch. 15/06/2025 | 600 | 582 | 0,07 | BCAP LLC Trust 3,790 % éch. 26/11/2036 | \$ 290 | 293 | 0,04 | |
| Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % éch. 15/12/2030 | £ 1 347 | 1 629 | 0,21 | 3,950 % éch. 01/12/2047 | 200 | 147 | 0,02 | 5,830 % éch. 25/03/2037 | 52 | 45 | 0,01 | |
| 6,135 % éch. 15/12/2030 | \$ 107 | 99 | 0,01 | 4,000 % éch. 01/12/2046 | 300 | 220 | 0,03 | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 6,239 % éch. 25/01/2035 | 11 | 10 | 0,00 | |
| 6,469 % éch. 15/09/2032 | £ 400 | 465 | 0,06 | Sprint LLC 7,625 % éch. 01/03/2026 | 800 | 836 | 0,11 | 7,660 % éch. 25/02/2036 | 10 | 8 | 0,00 | |
| Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | € 3 900 | 3 968 | 0,50 | System Energy Resources, Inc. 2,140 % éch. 09/12/2025 | 700 | 652 | 0,08 | Bear Stearns ALT-A Trust 4,189 % éch. 25/09/2035 | 83 | 36 | 0,01 | |
| Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % éch. 10/03/2025 | \$ 800 | 786 | 0,10 | Virginia Electric and Power Co. 3,750 % éch. 15/05/2027 | 2 900 | 2 833 | 0,36 | Brass PLC 5,940 % éch. 16/11/2066 | £ 910 | 1 161 | 0,15 | |
| Prosus NV 1,207 % éch. 19/01/2026 | € 1 000 | 1 042 | 0,13 | Total Obligations et billets privés | | 219 211 | 27,83 | Charter Mortgage Funding PLC 5,796 % éch. 16/01/2057 | 108 | 137 | 0,02 | |
| 2,085 % éch. 19/01/2030 | 1 300 | 1 204 | 0,15 | OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX | | | | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,972 % éch. 25/09/2035 | \$ 4 | 4 | 0,00 | |
| Sabine Pass Liquefaction LLC 5,000 % éch. 15/03/2027 | \$ 500 | 502 | 0,06 | Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, (ST APPROP Insured), Series 2021 | 3 000 | 395 | 0,05 | Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % éch. 25/04/2035 | 980 | 681 | 0,09 | |
| 5,750 % éch. 15/05/2024 | 100 | 100 | 0,01 | Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021 | 3 487 % éch. 01/06/2036 | 1 300 | 1 060 | 0,13 | 5,750 % éch. 25/05/2036 | 72 | 29 | 0,00 |
| 5,875 % éch. 30/06/2026 | 1 000 | 1 019 | 0,13 | Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021 | 2,587 % éch. 01/06/2029 | 4 000 | 3 537 | 0,45 | 5,750 % éch. 25/04/2047 | 298 | 263 | 0,03 |
| Sandoz Finance BV 3,970 % éch. 17/04/2027 | € 800 | 902 | 0,12 | Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007 | 0,000 % éch. 01/06/2047 (c) | 4 700 | 417 | 0,05 | 5,790 % éch. 25/09/2047 | 33 | 30 | 0,00 |
| Sands China Ltd. 2,550 % éch. 08/03/2027 | \$ 200 | 182 | 0,02 | Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020 | 3,151 % éch. 01/06/2032 | 200 | 167 | 0,02 | 5,890 % éch. 25/07/2046 | 11 | 9 | 0,00 |
| Sartorius Finance BV 4,250 % éch. 14/09/2026 | € 700 | 791 | 0,10 | 3,401 % éch. 01/06/2034 | 1 150 | 933 | 0,12 | 6,000 % éch. 25/11/2036 | 126 | 70 | 0,01 | |
| Sasol Financing USA LLC 5,875 % éch. 27/03/2024 | \$ 1 500 | 1 492 | 0,19 | 3,501 % éch. 01/06/2035 | 1 700 | 1 360 | 0,17 | 6,000 % éch. 25/07/2037 | 430 | 212 | 0,03 | |
| Scripps Escrow, Inc. 3,875 % éch. 15/01/2029 | 1 000 | 886 | 0,11 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | 6,012 % éch. 25/12/2035 | 43 | 35 | 0,01 | |
| Southern Co. 3,700 % éch. 30/04/2030 | 800 | 754 | 0,10 | Ginnie Mae 3,500 % éch. 15/07/2045 | 16 874 | 15 723 | 2,00 | 6,112 % éch. 20/12/2035 | 906 | 816 | 0,10 | |
| Spirit AeroSystems, Inc. 4,600 % éch. 15/06/2028 | 1 100 | 974 | 0,12 | Ginnie Mae, TBA 2,500 % éch. 01/01/2054 | 7 100 | 6 212 | 0,79 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 5,750 % éch. 25/12/2035 | 12 | 6 | 0,00 | |
| Studio City Finance Ltd. 5,000 % éch. 15/01/2029 | 1 400 | 1 178 | 0,15 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 3,500 % éch. 01/12/2047 | 11 904 | 11 015 | 1,40 | 5,750 % éch. 25/02/2037 | 481 | 219 | 0,03 | |
| Targa Resources Corp. 4,200 % éch. 01/02/2033 | 800 | 736 | 0,09 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | 3 000 | 16 827 | 2,14 | 5,750 % éch. 25/08/2037 | 612 | 327 | 0,04 | |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % éch. 27/07/2029 | € 900 | 847 | 0,11 | 3,500 % éch. 01/02/2054 | 27 800 | 25 532 | 3,24 | 6,000 % éch. 25/07/2036 | 264 | 138 | 0,02 | |
| 0,875 % éch. 29/05/2026 | 2 000 | 2 095 | 0,27 | 4,000 % éch. 01/02/2054 | 12 000 | 11 361 | 1,44 | 6,500 % éch. 25/11/2036 | 7 | 2 | 0,00 | |
| Thales S.A. 4,000 % éch. 18/10/2025 | 1 700 | 1 904 | 0,24 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 19 400 | 18 819 | 2,39 | Domi BV 4,775 % éch. 15/06/2051 | € 506 | 559 | 0,07 | |
| U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % éch. 15/05/2027 | \$ 152 | 145 | 0,02 | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 222 900 | 220 628 | 28,01 | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 5,660 % éch. 19/10/2036 | \$ 387 | 320 | 0,04 | |
| Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % éch. 24/11/2027 | € 1 000 | 943 | 0,12 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 23 200 | 23 305 | 2,96 | Dutch Property Finance BV 4,602 % éch. 28/07/2054 | € 237 | 261 | 0,03 | |
| Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % éch. 01/10/2026 ^ | \$ 200 | 55 | 0,01 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 28 500 | 28 940 | 3,67 | EMF-JK PLC 6,319 % éch. 13/03/2046 | £ 34 | 43 | 0,01 | |
| United Airlines Pass-Through Trust 2,700 % éch. 01/11/2033 | 1 000 | 848 | 0,11 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | Eurohome UK Mortgages PLC 5,490 % éch. 15/06/2044 | 66 | 83 | 0,01 | |
| United Airlines, Inc. 4,375 % éch. 15/04/2026 | 800 | 780 | 0,10 | Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041 | 15 600 | 11 224 | 1,42 | European Loan Conduit DAC 4,994 % éch. 17/02/2030 | € 3 440 | 3 751 | 0,48 | |
| 4,625 % éch. 15/04/2029 | 400 | 375 | 0,05 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e) 0,625 % éch. 15/07/2032 | 18 002 | 16 457 | 2,09 | Eurosail PLC 6,289 % éch. 13/06/2045 | £ 203 | 258 | 0,03 | |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % éch. 01/11/2033 | 5 000 | 4 243 | 0,54 | 1,125 % éch. 15/01/2033 | 16 423 | 15 548 | 1,97 | Friary PLC 5,940 % éch. 21/11/2067 | 394 | 504 | 0,06 | |
| Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030 | £ 1 800 | 2 012 | 0,26 | 1,375 % éch. 15/07/2033 | 15 399 | 14 941 | 1,90 | Great Hall Mortgages PLC 5,479 % éch. 18/06/2039 | 44 | 55 | 0,01 | |
| Vmed O2 UK Financing PLC 4,500 % éch. 15/07/2031 | 700 | 774 | 0,10 | 2,500 % éch. 15/01/2029 | 43 | 44 | 0,01 | 5,489 % éch. 18/06/2038 | 10 | 13 | 0,00 | |
| Wynn Macau Ltd. 5,500 % éch. 01/10/2027 | \$ 200 | 189 | 0,02 | Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 30/09/2025 (j) | 24 400 | 22 727 | 2,89 | GSMPS Mortgage Loan Trust 5,820 % éch. 25/03/2035 | \$ 86 | 76 | 0,01 | |
| | | | | 0,375 % éch. 30/11/2025 | 15 600 | 14 489 | 1,84 | GSR Mortgage Loan Trust 6,000 % éch. 25/01/2037 | 1 195 | 736 | 0,09 | |
| | | | | 1,875 % éch. 31/08/2024 | 650 | 637 | 0,08 | HarborView Mortgage Loan Trust 5,850 % éch. 19/01/2038 | 35 | 30 | 0,00 | |
| | | | | | | | | 5,880 % éch. 19/12/2036 | 3 845 | 3 072 | 0,39 | |
| | | | | | | | | 7,012 % éch. 19/10/2035 | 451 | 247 | 0,03 | |
| | | | | | | | | Harmony French Home Loans 4,606 % éch. 27/05/2062 | € 5 610 | 6 217 | 0,79 | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| IndyMac Mortgage Loan Trust | | | | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | |
| 5,890 % éch. 25/07/2036 | \$ 1 742 | \$ 1 691 | 0,22 | 5,750 % éch. 25/07/2036 | \$ 95 | \$ 71 | 0,01 | 4,652 % éch. 21/07/2030 | € 3 818 | \$ 4 170 | 0,53 |
| JPMorgan Alternative Loan Trust | | | | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 1 030 | 340 | 0,04 | 4,725 % éch. 15/04/2032 | 3 304 | 3 618 | 0,46 |
| 5,830 % éch. 25/06/2037 | 3 990 | 2 090 | 0,27 | 6,085 % éch. 25/12/2035 | 2 593 | 2 393 | 0,30 | 4,782 % éch. 15/08/2032 | 5 455 | 5 970 | 0,76 |
| Jubilee Place BV | | | | Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | Dryden Euro CLO DAC | | | |
| 4,985 % éch. 17/10/2057 | € 1 445 | 1 601 | 0,20 | 5,940 % éch. 25/11/2035 | 896 | 872 | 0,11 | 4,625 % éch. 15/04/2033 | 4 477 | 4 873 | 0,62 |
| Landmark Mortgage Securities PLC | | | | 6,340 % éch. 25/01/2036 | 3 400 | 3 213 | 0,41 | 4,815 % éch. 15/07/2031 | 470 | 516 | 0,07 |
| 5,620 % éch. 17/04/2044 | £ 136 | 169 | 0,02 | 6,490 % éch. 25/09/2034 | 950 | 934 | 0,12 | Elevation CLO Ltd. | | | |
| Lehman XS Trust | | | | Apidos CLO | | | | 6,885 % éch. 15/10/2029 | \$ 645 | 646 | 0,08 |
| 5,870 % éch. 25/08/2046 | \$ 169 | 154 | 0,02 | 6,687 % éch. 20/04/2031 | 946 | 946 | 0,12 | Ellington Loan Acquisition Trust | | | |
| 5,920 % éch. 25/08/2046 | 339 | 325 | 0,04 | Ares European CLO DAC | | | | 6,570 % éch. 25/05/2037 | 2 982 | 2 875 | 0,36 |
| Ludgate Funding PLC | | | | 4,843 % éch. 20/04/2032 | € 2 500 | 2 718 | 0,34 | Euro-Galaxy CLO DAC | | | |
| 4,155 % éch. 01/12/2060 | € 18 | 19 | 0,00 | Argent Securities Trust | | | | 4,693 % éch. 11/04/2031 | € 1 036 | 1 134 | 0,14 |
| 5,539 % éch. 01/12/2060 | £ 123 | 151 | 0,02 | 5,690 % éch. 25/05/2036 | \$ 163 | 40 | 0,01 | Fieldstone Mortgage Investment Trust | | | |
| Mansard Mortgages PLC | | | | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 100 | 87 | 0,01 | 6,137 % éch. 25/04/2047 | \$ 1 908 | 1 338 | 0,17 |
| 5,520 % éch. 15/04/2047 | 34 | 42 | 0,01 | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | Fremont Home Loan Trust | | | |
| 5,989 % éch. 15/12/2049 | 112 | 141 | 0,02 | 5,950 % éch. 25/05/2035 | 71 | 60 | 0,01 | 5,605 % éch. 25/10/2036 | 142 | 125 | 0,02 |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust | | | | Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | | 5,670 % éch. 25/08/2036 | 207 | 67 | 0,01 |
| 7,220 % éch. 25/11/2034 | \$ 648 | 628 | 0,08 | 6,745 % éch. 15/01/2031 | 2 257 | 2 260 | 0,29 | 6,340 % éch. 25/05/2034 | 1 275 | 1 202 | 0,15 |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | Bain Capital Euro CLO DAC | | | | GE-WMC Mortgage Securities Trust | | | |
| 4,118 % éch. 25/12/2037 | 998 | 682 | 0,09 | 5,102 % éch. 24/01/2033 | € 2 000 | 2 192 | 0,28 | 5,770 % éch. 25/08/2036 | 5 077 | 2 111 | 0,27 |
| 6,354 % éch. 25/08/2036 | 10 498 | 2 003 | 0,25 | BBVA Consumer Auto | | | | Greenwood Park CLO Ltd. | | | |
| Mortgage Equity Conversion Asset Trust | | | | 0,270 % éch. 20/07/2031 | 281 | 303 | 0,04 | 6,685 % éch. 15/04/2031 | 1 232 | 1 232 | 0,16 |
| 5,340 % éch. 25/05/2042 | 271 | 260 | 0,03 | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | | Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. | | | |
| NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates | | | | 5,700 % éch. 25/02/2037 | \$ 3 000 | 2 805 | 0,36 | 6,656 % éch. 15/09/2037 | 848 | 847 | 0,11 |
| 6,500 % éch. 25/02/2035 | 461 | 387 | 0,05 | 6,100 % éch. 25/02/2036 | 1 104 | 1 101 | 0,14 | GSAA Home Equity Trust | | | |
| New Century Alternative Mortgage Loan Trust | | | | 6,325 % éch. 25/07/2034 | 1 254 | 1 214 | 0,15 | 5,772 % éch. 25/11/2036 | 463 | 138 | 0,02 |
| 4,688 % éch. 25/10/2036 | 500 | 98 | 0,01 | 6,490 % éch. 25/10/2035 | 283 | 278 | 0,04 | 5,985 % éch. 25/06/2036 | 1 329 | 353 | 0,04 |
| Newgate Funding PLC | | | | 6,520 % éch. 25/08/2037 | 783 | 681 | 0,09 | GSAMP Trust | | | |
| 4,525 % éch. 15/12/2050 | € 72 | 78 | 0,01 | Black Diamond CLO DAC | | | | 5,610 % éch. 25/11/2036 | 1 870 | 901 | 0,11 |
| 5,500 % éch. 15/12/2050 | £ 201 | 246 | 0,03 | 4,982 % éch. 15/05/2032 | € 4 494 | 4 902 | 0,62 | 5,990 % éch. 25/02/2046 | 522 | 485 | 0,06 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust | | | | Blackrock European CLO DAC | | | | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | |
| 6,523 % éch. 25/09/2046 | \$ 2 090 | 733 | 0,09 | 4,585 % éch. 15/10/2031 | 5 303 | 5 766 | 0,73 | 6,250 % éch. 25/01/2036 | 2 200 | 1 816 | 0,23 |
| OBX Trust | | | | Cairn CLO DAC | | | | ICG U.S. CLO Ltd. | | | |
| 6,120 % éch. 25/06/2057 | 127 | 122 | 0,02 | 4,618 % éch. 31/01/2030 | 591 | 647 | 0,08 | 6,754 % éch. 22/07/2031 | 4 822 | 4 824 | 0,61 |
| Paragon Mortgages PLC | | | | Carlyle Euro CLO DAC | | | | Lehman XS Trust | | | |
| 6,270 % éch. 15/05/2045 | £ 182 | 232 | 0,03 | 4,632 % éch. 15/08/2030 | 2 323 | 2 543 | 0,32 | 6,299 % éch. 25/03/2037 | 1 738 | 1 705 | 0,22 |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust | | | | Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. | | | | LoanCore Issuer Ltd. | | | |
| 5,750 % éch. 25/06/2036 | \$ 19 | 14 | 0,00 | 6,755 % éch. 15/10/2030 | \$ 1 378 | 1 378 | 0,17 | 6,888 % éch. 17/01/2037 | 500 | 490 | 0,06 |
| 6,000 % éch. 25/04/2036 | 924 | 730 | 0,09 | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | | | | Long Beach Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/06/2036 | 131 | 101 | 0,01 | 4,752 % éch. 15/11/2031 | € 799 | 870 | 0,11 | 5,910 % éch. 25/02/2036 | 294 | 286 | 0,04 |
| Residential Asset Securitization Trust | | | | CBAM Ltd. | | | | 6,385 % éch. 25/08/2035 | 4 270 | 3 775 | 0,48 |
| 6,500 % éch. 25/06/2037 | 2 921 | 668 | 0,09 | 6,927 % éch. 20/07/2030 | \$ 1 736 | 1 737 | 0,22 | Man GLG Euro CLO DAC | | | |
| RMAC Securities PLC | | | | Cedar Funding CLO Ltd. | | | | 4,645 % éch. 15/10/2030 | € 1 532 | 1 682 | 0,21 |
| 5,489 % éch. 12/06/2044 | £ 40 | 49 | 0,01 | 6,657 % éch. 20/04/2031 | 1 082 | 1 082 | 0,14 | 4,702 % éch. 15/05/2031 | 378 | 414 | 0,05 |
| Shamrock Residential DAC | | | | 6,677 % éch. 20/01/2031 | 4 762 | 4 758 | 0,60 | 4,835 % éch. 15/01/2030 | 262 | 290 | 0,04 |
| 4,726 % éch. 24/01/2061 | € 3 032 | 3 338 | 0,42 | CIFC Funding Ltd. | | | | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | |
| Stratton BTL Mortgage Funding PLC | | | | 6,657 % éch. 18/04/2031 | 687 | 686 | 0,09 | 5,540 % éch. 25/10/2036 | \$ 1 390 | 600 | 0,08 |
| 5,951 % éch. 20/01/2054 | £ 8 003 | 10 173 | 1,29 | CIT Mortgage Loan Trust | | | | 5,600 % éch. 25/11/2036 | 1 609 | 723 | 0,09 |
| Stratton Mortgage Funding PLC | | | | 6,970 % éch. 25/10/2037 | 5 460 | 5 403 | 0,69 | 5,610 % éch. 25/05/2037 | 1 316 | 1 117 | 0,14 |
| 6,069 % éch. 25/09/2051 | 7 425 | 9 463 | 1,20 | Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | 5,700 % éch. 25/10/2036 | 1 133 | 594 | 0,08 |
| 6,121 % éch. 20/07/2060 | 3 168 | 4 038 | 0,51 | 5,530 % éch. 25/07/2045 | 373 | 256 | 0,03 | 5,700 % éch. 25/11/2036 | 5 033 | 2 869 | 0,36 |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust | | | | 5,640 % éch. 25/07/2045 | 6 949 | 4 791 | 0,61 | 5,720 % éch. 25/07/2036 | 412 | 362 | 0,05 |
| 5,910 % éch. 25/09/2047 | \$ 643 | 553 | 0,07 | 5,770 % éch. 25/12/2036 | 97 | 39 | 0,00 | 5,770 % éch. 25/09/2036 | 14 972 | 5 308 | 0,67 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC | | | | 7,250 % éch. 25/05/2036 | 814 | 423 | 0,05 | 5,970 % éch. 25/04/2036 | 95 | 89 | 0,01 |
| 6,365 % éch. 20/10/2051 | £ 2 908 | 3 711 | 0,47 | Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | 6,010 % éch. 25/12/2034 | 1 362 | 1 227 | 0,16 |
| 6,571 % éch. 20/07/2045 | 1 093 | 1 397 | 0,18 | 6,415 % éch. 25/10/2034 | 44 | 42 | 0,01 | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | |
| 6,690 % éch. 20/02/2045 | 194 | 246 | 0,03 | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | 5,980 % éch. 25/02/2036 | 1 800 | 1 638 | 0,21 |
| Twin Bridges PLC | | | | 5,730 % éch. 25/03/2037 | 2 829 | 2 443 | 0,31 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | |
| 6,070 % éch. 12/03/2055 | 6 846 | 8 695 | 1,10 | Contego CLO BV | | | | 6,226 % éch. 25/10/2036 | 266 | 78 | 0,01 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | 4,735 % éch. 15/10/2030 | € 1 596 | 1 748 | 0,22 | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | | | |
| 3,787 % éch. 25/02/2037 | \$ 67 | 61 | 0,01 | Contego CLO DAC | | | | 6,270 % éch. 25/02/2037 | 3 126 | 917 | 0,12 |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | 4,642 % éch. 23/01/2030 | 3 986 | 4 341 | 0,55 | NovaStar Mortgage Funding Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/07/2036 | 97 | 57 | 0,01 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 5,630 % éch. 25/09/2037 | 13 | 12 | 0,00 |
| Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust | | | | 4,877 % éch. 25/05/2036 | \$ 2 138 | 2 108 | 0,27 | 5,790 % éch. 25/05/2036 | 39 | 38 | 0,00 |
| 5,615 % éch. 25/07/2034 | 8 | 8 | 0,00 | 5,610 % éch. 25/06/2035 | 3 206 | 2 806 | 0,36 | Oak Hill European Credit Partners DAC | | | |
| | | 82 175 | 10,43 | 5,650 % éch. 25/11/2047 | 559 | 622 | 0,08 | 4,723 % éch. 20/01/2032 | € 611 | 670 | 0,08 |
| | | | | 5,670 % éch. 25/06/2047 | 2 724 | 2 437 | 0,31 | Option One Mortgage Loan Trust | | | |
| | | | | 5,680 % éch. 25/05/2047 | 70 | 62 | 0,01 | 5,610 % éch. 25/01/2037 | \$ 49 | 28 | 0,00 |
| | | | | 5,690 % éch. 25/09/2037 | 328 | 334 | 0,04 | 5,610 % éch. 25/02/2037 | 600 | 389 | 0,05 |
| | | | | 6,130 % éch. 25/08/2035 | 275 | 267 | 0,03 | 5,610 % éch. 25/03/2037 | 682 | 602 | 0,08 |
| | | | | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC | | | | 5,690 % éch. 25/04/2037 | 559 | 391 | 0,05 |
| | | | | 3,072 % éch. 25/12/2036 | 154 | 127 | 0,02 | 5,690 % éch. 25/05/2037 | 619 | 366 | 0,05 |
| | | | | 6,385 % éch. 25/01/2034 | 449 | 457 | 0,06 | OZLM Ltd. | | | |
| | | | | | | | | 6,675 % éch. 15/04/2031 | 2 215 | 2 214 | 0,28 |
| | | | | | | | | 6,744 % éch. 17/04/2031 | 914 | 914 | 0,12 |
| | | | | | | | | 6,827 % éch. 20/01/2031 | 1 444 | 1 446 | 0,18 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------|
| OZLME DAC | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | |
| 4,758 % éch. 27/07/2032 | € 2 186 | \$ 2 392 | 0,30 | Obligation internationale du gouvernement argentin | \$ 1 422 | \$ 570 | 0,07 | BONS DU TRÉSOR ARGENTIN | | | | |
| Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | 0,750 % éch. 09/07/2030 | | | | (34,368) % éch. | | | | |
| 5,938 % éch. 12/04/2032 | 4 613 | 5 112 | 0,65 | 1,000 % éch. 09/07/2029 | 150 | 60 | 0,01 | 20/05/2024 (c)(d) ARS | 15 316 | \$ 24 | 0,00 | |
| Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust | | | | 3,625 % éch. 09/07/2035 | 2 504 | 854 | 0,11 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | |
| 5,965 % éch. 25/07/2036 | \$ 605 | 564 | 0,07 | Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | | 10,900 % éch. | | | | |
| RAAC Trust | | | | 0,000 % éch. 01/01/2024 | | | | 04/01/2024 (c)(d) HUF | 3 335 000 | 9 633 | 1,22 | |
| 6,230 % éch. 25/10/2046 | 86 | 83 | 0,01 | (c) | BRL 22 000 | 4 529 | 0,58 | Total des Instruments à court terme | | 9 657 | 1,22 | |
| Residential Asset Securities Corp. Trust | | | | 0,000 % éch. 01/07/2024 | | | | Total des Valeurs mobilières | | \$ 1 047 330 | 132,97 | |
| 5,810 % éch. 25/11/2036 | 41 | 39 | 0,00 | (c) | 64 100 | 12 557 | 1,59 | | | | | |
| 6,055 % éch. 25/03/2036 | 822 | 810 | 0,10 | Obligation internationale du gouvernement israélien | € 3 300 | 3 731 | 0,47 | | | | | |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | | 5,000 % éch. 30/10/2026 | | | | ACTIONS | | | | |
| 5,790 % éch. 25/10/2036 | 9 599 | 3 233 | 0,41 | Japan Finance Organization for Municipalities | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | |
| 6,130 % éch. 25/08/2035 | 54 | 43 | 0,01 | 0,050 % éch. 12/02/2027 | 1 500 | 1 523 | 0,19 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | |
| Segovia European CLO DAC | | | | Obligation internationale du gouvernement mexicain | \$ 1 700 | 1 744 | 0,22 | PIMCO Funds: Global | | | | |
| 4,873 % éch. 20/07/2032 | € 6 900 | 7 525 | 0,96 | 5,400 % éch. 09/02/2028 | | | | Investors Series plc - | | | | |
| SG Mortgage Securities Trust | | | | Obligation internationale du gouvernement péruvien | 5,940 % éch. 12/02/2029 | PEN 2 300 | 621 | 0,08 | Fonds PIMCO Asia | | | |
| 5,680 % éch. 25/10/2036 | \$ 3 600 | 2 564 | 0,33 | Obligation internationale du gouvernement roumain | 1,750 % éch. 13/07/2030 | € 1 500 | 1 344 | 0,17 | High Yield Bond | 385 356 | 3 561 | 0,45 |
| Sierra Madre Funding Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement russe | | | | Fund (g) | | | | |
| 5,854 % éch. 07/09/2039 | 1 987 | 1 399 | 0,18 | 5,250 % éch. | 23/06/2047 ^ | \$ 200 | 71 | 0,01 | PIMCO Funds: | | | |
| Sound Point CLO Ltd. | | | | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 4,850 % éch. 30/09/2029 | 2 000 | 1 880 | 0,24 | Global Investors | | | |
| 6,741 % éch. 26/07/2031 | 993 | 992 | 0,13 | Obligation internationale du gouvernement turc | 5,750 % éch. 22/03/2024 | 1 000 | 1 001 | 0,13 | Series plc - Fonds | | | |
| 6,807 % éch. 18/04/2031 | 7 400 | 7 394 | 0,94 | 6,350 % éch. 10/08/2024 | 2 500 | 2 516 | 0,32 | Asia Strategic Interest | 1 197 507 | 11 077 | 1,41 | |
| Soundview Home Loan Trust | | | | | | | | Bond Fund (g) | | | | |
| 5,670 % éch. 25/06/2037 | 2 163 | 1 524 | 0,19 | | | | | PIMCO Select Funds plc - | | | | |
| 5,730 % éch. 25/02/2037 | 982 | 278 | 0,04 | | | | | Fonds PIMCO | | | | |
| 5,970 % éch. 25/10/2036 | 1 294 | 1 213 | 0,15 | | | | | US Dollar Short-Term | 197 937 | 1 972 | 0,25 | |
| Structured Asset Investment Loan Trust | | | | | | | | Floating NAV Fund (g) | | 16 610 | 2,11 | |
| 6,445 % éch. 25/01/2035 | 1 685 | 1 523 | 0,19 | | | | | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | | |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | | | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds | | | | |
| 5,625 % éch. 25/09/2036 | 4 588 | 2 848 | 0,36 | ACTIONS ORDINAIRES | | | | PIMCO US Dollar | | | | |
| 6,957 % éch. 25/04/2035 | 25 | 25 | 0,00 | ÉNERGIE | | | | Short Maturity UCITS | 543 400 | 54 188 | 6,88 | |
| Toro European CLO DAC | | | | Constellation Oil | | | | ETF (g) | | | | |
| 4,885 % éch. 15/07/2030 | € 82 | 91 | 0,01 | Services Holding | 617 385 | 67 | 0,01 | Total des Fonds d'investissement | | \$ 70 798 | 8,99 | |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust | | | | S.A. « B » (b)(i) | | | | | | | | |
| 5,695 % éch. 25/05/2037 | \$ 443 | 411 | 0,05 | TITRES PRIVILÉGIÉS | | | | | | | | |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | | Nationwide Building Society | 10,250 % | 521 | 87 | 0,01 | | | | |
| 6,070 % éch. 25/04/2037 | 4 701 | 3 201 | 0,41 | | | | | | | | | |
| 7,195 % éch. 25/11/2035 | 93 | 93 | 0,01 | | | | | | | | | |
| | | 193 005 | 24,51 | | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|-------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 2 805 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | \$ (2 861) | \$ 2 805 | \$ 2 806 | 0,36 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (2 861) | \$ 2 805 | \$ 2 806 | 0,36 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 133 | \$ (618) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 242 | (527) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 131 | (600) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 12 | 152 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 441 | (328) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 305 | 655 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 963 | (2 361) | (0,30) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 1 529 | (5 025) | (0,64) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 812 | (2 172) | (0,27) |
| | | | | \$ (10 824) | (1,37) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (10 824) | (1,37) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 3 200 | \$ 11 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | 1 700 | (15) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 200 | 3 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20/06/2027 | 500 | 31 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 1 700 | 17 | 0,00 |
| | | | | \$ 47 | 0,01 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-34 Index à 5 ans | (5,000) % | 20/06/2025 | \$ 20 470 | \$ (2 125) | (0,27) |
| Indice CDX.HY-39 Index à 5 ans | (5,000) | 20/12/2027 | 7 450 | (569) | (0,08) |
| | | | | \$ (2 694) | (0,35) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 % | 20/03/2029 | £ 10 100 | \$ (736) | (0,09) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2026 | \$ 16 480 | (1 024) | (0,13) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 17/06/2030 | 5 000 | 595 | 0,08 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 19/09/2028 | 53 900 | 1 138 | 0,14 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,725 | 19/09/2028 | 39 400 | 839 | 0,11 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 21/12/2052 | 29 700 | 2 072 | 0,26 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,827 | 03/07/2028 | 13 300 | (1 046) | (0,13) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,842 | 19/09/2053 | 1 300 | (59) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,853 | 18/05/2032 | 37 780 | (4 918) | (0,62) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,874 | 19/09/2053 | 10 400 | (511) | (0,06) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,999 | 03/07/2053 | 11 500 | 2 394 | 0,30 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 27/10/2028 | 31 000 | (2 330) | (0,30) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 12/02/2030 | 9 900 | 1 131 | 0,14 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 10/03/2030 | 4 900 | 468 | 0,06 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,060 | 27/10/2053 | 6 200 | 1 456 | 0,18 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 4 700 | (68) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 4 600 | (62) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 13 000 | 76 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 4 600 | (62) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 | 25/10/2024 | 4 600 | (54) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 4 600 | (52) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 4 600 | (50) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 01/03/2033 | 1 200 | (23) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400 | 23/02/2033 | 2 800 | (47) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430 | 27/02/2033 | 1 900 | (27) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 36 100 | (330) | (0,04) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 1 200 | (17) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 24 600 | (198) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 13 300 | (103) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 700 | (20) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 1 400 | (50) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 3 300 | 195 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 1 000 | (59) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,628 | 02/01/2026 | BRL 138 600 | (4) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,083 | 04/01/2027 | 18 600 | 22 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,115 | 04/01/2027 | 92 700 | 104 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,126 | 04/01/2027 | 29 800 | 36 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,755 | 02/01/2025 | 24 800 | (14) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,900 | 04/01/2027 | 14 300 | 91 | 0,01 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,000 | 21/06/2025 | CAD 93 700 | 128 | 0,02 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | AUD 97 900 | 1 777 | 0,23 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | € 11 000 | 51 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 11 300 | 52 | 0,01 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 12 400 | 785 | 0,10 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 18 400 | (743) | (0,09) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,985 | 11/10/2027 | PLN 29 300 | (664) | (0,08) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 7,015 | 11/10/2027 | 53 100 | (1 219) | (0,15) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 7,156 | 13/10/2027 | 54 000 | (572) | (0,07) |
| | | | | | \$ (1 652) | (0,21) |
| | | | | | \$ (4 299) | (0,55) |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

- (1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notional du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notional du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notional du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notional du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notional ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|---------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 700 | \$ (3) | \$ (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 700 | (3) | (1) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 800 | (3) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 2 000 | (9) | (25) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 800 | (4) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 2 000 | (9) | (1) | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 700 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 700 | (3) | (2) | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 800 | (4) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 1 200 | (5) | (15) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 800 | (4) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 1 200 | (5) | 0 | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 1 000 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 1 000 | (5) | (11) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 1 000 | (5) | (13) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 1 000 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 1 000 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 1 000 | (5) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 1 400 | (7) | (8) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 800 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 1 900 | (9) | (30) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 1 400 | (6) | (25) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 1 400 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 800 | (4) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 1 900 | (9) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 1 400 | (6) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (137) | \$ (161) | (0,02) |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notional ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|---------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | \$ 97,891 | 09/01/2024 | 2 000 | \$ (8) | \$ (23) | (0,01) |
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 95,813 | 06/02/2024 | 1 500 | (8) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 97,813 | 06/02/2024 | 1 500 | (8) | (8) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | 98,469 | 09/01/2024 | 1 600 | (7) | (11) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2054 | 96,813 | 06/02/2024 | 1 300 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2054 | 100,813 | 06/02/2024 | 1 300 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | \$ (37) | \$ (53) | (0,01) |

(1) Le montant notional représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notional ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|----------------------|-----------------|---------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BRC | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 200 | \$ (26) | \$ 27 | \$ 1 | 0,00 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2024 | 200 | (3) | 4 | 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement sud-africain | 1,000 | 20/06/2024 | 2 300 | (102) | 110 | 8 | 0,00 |
| | | | | | \$ (131) | \$ 141 | \$ 10 | 0,00 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17/11/2059 | \$ 2 200 | \$ (9) | \$ 9 | \$ 0 | 0,00 |
| MYC | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 100 | (4) | 4 | 0 | 0,00 |
| SAL | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 1 500 | (3) | 3 | 0 | 0,00 |
| UAG | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 300 | (10) | 10 | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ (26) | \$ 26 | \$ 0 | 0,00 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 1 989 | AUD 3 003 | \$ 61 | \$ 0 | \$ 61 | 0,01 |
| BOA | 01/2024 | COP 8 659 799 | \$ 2 264 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 2 138 | 2 716 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 692 534 | 1 907 | 0 | (89) | (89) | (0,01) |
| | 01/2024 | PLN 2 080 | 492 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 153 | COP 8 659 799 | 80 | 0 | 80 | 0,01 |
| | 01/2024 | 611 | HUF 213 993 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 6 285 | ¥ 927 499 | 298 | 0 | 298 | 0,04 |
| | 01/2024 | 353 | PLN 1 490 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY 117 | \$ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 30 | CNH 215 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 231 | COP 8 659 799 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | BRL 60 747 | \$ 12 585 | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| | 01/2024 | € 885 | 970 | 3 | (11) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 8 151 | 10 339 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 148 985 | 424 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 751 | AUD 1 137 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 01/2024 | 443 | € 405 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 | HUF 1 430 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 996 | ZAR 36 998 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY 159 | \$ 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD 319 | 10 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | 820 | 26 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ 12 585 | BRL 61 360 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| BRC | 01/2024 | € 181 122 | \$ 199 194 | 0 | (928) | (928) | (0,12) |
| | 01/2024 | HUF 771 327 | 2 167 | 0 | (56) | (56) | (0,01) |
| | 01/2024 | PLN 61 183 | 13 993 | 0 | (1 562) | (1 562) | (0,20) |
| | 01/2024 | \$ 1 103 | £ 866 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 625 | PLN 2 694 | 60 | 0 | 60 | 0,01 |
| | 01/2024 | 553 | TRY 16 487 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 218 | 6 642 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 303 | 72 352 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 04/2024 | 1 446 | 46 615 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| BSH | 01/2024 | BRL 83 000 | \$ 16 653 | 0 | (434) | (434) | (0,05) |
| CBK | 01/2024 | HUF 84 048 | 240 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 164 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 2 237 | 561 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 036 | AUD 1 541 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 01/2024 | 17 037 | BRL 82 952 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| | 01/2024 | 467 | HUF 163 860 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 751 | PLN 11 547 | 185 | 0 | 185 | 0,02 |
| | 02/2024 | 7 357 | BRL 37 739 | 398 | 0 | 398 | 0,05 |
| | 03/2024 | BRL 5 422 | \$ 1 098 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN 12 741 | 3 384 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 04/2024 | BRL 83 792 | 17 037 | 0 | (71) | (71) | (0,01) |
| GLM | 01/2024 | MXN 485 | 28 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 1 068 | 252 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 12 574 | BRL 61 000 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL 64 | \$ 13 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 374 | TRY 11 739 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2024 | BRL 64 100 | \$ 12 941 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 873 | 955 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 619 639 | 1 691 | 0 | (95) | (95) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 934 | AUD 1 409 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 193 | HUF 446 935 | 95 | 0 | 95 | 0,01 |
| | 01/2024 | 888 | TRY 26 398 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 1 602 | \$ 51 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | € 25 | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 43 981 | 125 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR 27 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 3 937 | 984 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 497 | £ 390 | \$ 1 | \$ (1) | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 088 | HUF 769 066 | 128 | 0 | 128 | 0,02 |
| | 01/2024 | 2 390 | ¥ 352 325 | 111 | 0 | 111 | 0,01 |
| | 01/2024 | 258 | PLN 1 073 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 02/2024 | CNY 122 | \$ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 03/2024 | THB 22 627 | 655 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | £ 1 295 | 1 630 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 084 | CLP 958 527 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | 3 950 | ¥ 579 402 | 163 | 0 | 163 | 0,02 |
| UAG | 01/2024 | £ 44 286 | \$ 56 044 | 0 | (413) | (413) | (0,05) |
| | 01/2024 | \$ 756 | AUD 1 139 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 01/2024 | 559 | HUF 205 634 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 440 | MXN 25 492 | 59 | 0 | 59 | 0,01 |
| | 01/2024 | 119 | PLN 464 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 34 181 | \$ 1 791 | 0 | (76) | (76) | (0,01) |
| | | | | \$ 2 011 | \$ (4 181) | \$ (2 170) | (0,27) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 15 | \$ 16 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 885 | € 806 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € 54 | \$ 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 38 | € 35 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 827 | \$ 904 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 10 127 | € 9 211 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 10 133 | 9 219 | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| RYL | 01/2024 | € 4 993 | \$ 5 483 | 0 | (35) | (35) | (0,01) |
| UAG | 01/2024 | \$ 9 957 | € 9 052 | 45 | 0 | 45 | 0,01 |
| | | | | \$ 153 | \$ (44) | \$ 109 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 365 | \$ 462 | \$ 0 | \$ (4) | \$ (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 11 030 | £ 8 684 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | 34 680 | 27 341 | 175 | 0 | 175 | 0,02 |
| BRC | 01/2024 | 568 | 450 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 20 | \$ 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 599 | £ 4 445 | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | 9 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 249 | \$ 317 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 636 | £ 3 642 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 57 | \$ 72 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | \$ 35 342 | £ 27 921 | 254 | 0 | 254 | 0,03 |
| SCX | 01/2024 | 212 181 | 167 748 | 1 672 | 0 | 1 672 | 0,21 |
| SSB | 01/2024 | 123 103 | 97 557 | 1 266 | 0 | 1 266 | 0,16 |
| UAG | 01/2024 | £ 37 | \$ 47 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 212 161 | £ 167 639 | 1 553 | 0 | 1 553 | 0,20 |
| | | | | \$ 5 040 | \$ (6) | \$ 5 034 | 0,64 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 2 769 0,35

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 2,000 % éch. 01/02/2054 | \$ 50 800 | \$ (41 577) | (5,28) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (41 577) | (5,28) |
| Total des Investissements | | \$ 1 067 002 | 135,47 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (279 378) | (35,47) |
| Actifs nets | | \$ 787 624 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,12 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|--------------|-------|--------------|---------------------|
| Constellation Oil Services Holding S.A. « B » | 10/06/2022 | \$ 67 | \$ 67 | 0,01 |

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 15 094 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 23 168 \$ (31 décembre 2022 : 29 843 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 4 454 \$ (31 décembre 2022 : 27 963 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 047 125 | \$ 205 | \$ 1 047 330 |
| Fonds d'investissement | 16 610 | 54 188 | 0 | 70 798 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 2 805 | 0 | 2 805 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (1 303) | (11 051) | 0 | (12 354) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (41 577) | 0 | (41 577) |
| Totaux | \$ 15 307 | \$ 1 051 490 | \$ 205 | \$ 1 067 002 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 216 185 | \$ 561 | \$ 1 216 746 |
| Fonds d'investissement | 72 181 | 60 875 | 0 | 133 056 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 118 800 | 0 | 118 800 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 79 | (54 248) | 0 | (54 169) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (94 108) | 0 | (94 108) |
| Totaux | \$ 72 260 | \$ 1 247 504 | \$ 561 | \$ 1 320 325 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 3,200 % | 28/09/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (241) | \$ (268) | (0,04) |
| SCX | 5,750 | 28/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (14 807) | (14 817) | (1,88) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (15 085) | (1,92) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 61 | \$ 0 | \$ 61 | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | 286 | (290) | (4) | (3 452) | 3 430 | (22) |
| BPS | 156 | 0 | 156 | (3 383) | 3 100 | (283) |
| BRC | (2 528) | 3 690 | 1 162 | (105) | 30 | (75) |
| BSH | (434) | 410 | (24) | S/O | S/O | S/O |
| CBK | 564 | (670) | (106) | 287 | (540) | (253) |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (20) | 0 | (20) |
| FAR | (21) | 0 | (21) | (1 707) | 1 460 | (247) |
| GLM | (97) | 250 | 153 | (15 394) | 15 157 | (237) |
| GST | 9 | 0 | 9 | (12) | 22 | 10 |
| MBC | 64 | 0 | 64 | (1 943) | 1 280 | (663) |
| MYC | (68) | 10 | (58) | (1 783) | 1 490 | (293) |
| MYI | 287 | (260) | 27 | 510 | (320) | 190 |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (28) | 0 | (28) |
| RYL | 219 | (310) | (91) | (25) | 0 | (25) |
| SAL | (30) | 94 | 64 | (102) | 94 | (8) |
| SCX | 1 659 | (2 030) | (371) | 354 | (460) | (106) |
| SSB | 1 258 | (1 080) | 178 | (2 629) | 1 900 | (729) |
| TOR | 163 | 0 | 163 | 191 | (750) | (559) |
| UAG | 1 221 | (1 140) | 81 | 42 | (20) | 22 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 62,81 | 44,59 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 70,04 | 43,14 |
| Autres valeurs mobilières | 0,12 | 2,68 |
| Fonds d'investissement | 8,99 | 9,89 |
| Contrats de mise en pension | 0,36 | 8,83 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (1,37) | 0,66 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,55) | (2,52) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,35 | (2,17) |
| Titres vendus à découvert | (5,28) | (6,99) |
| Contrats de prise en pension | (1,92) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 1,36 | 2,57 |
| Obligations et billets privés | 27,83 | 23,54 |
| Obligations et billets municipaux | 0,99 | 0,56 |
| Agences du gouvernement américain | 48,04 | 14,02 |
| Obligations du Trésor américain | 14,38 | 14,38 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 10,43 | 7,79 |
| Titres adossés à des actifs | 24,51 | 17,36 |
| Émissions souveraines | 4,19 | 2,15 |
| Actions ordinaires | 0,01 | 0,01 |
| Titres privilégiés | 0,01 | 0,03 |
| Instruments à court terme | 1,22 | 8,00 |
| Fonds d'investissement | 8,99 | 9,89 |
| Contrats de mise en pension | 0,36 | 8,83 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (1,37) | 0,69 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | (0,03) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,35) | (0,15) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,21) | (2,37) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | 0,75 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (2,34) |
| Options sur titres | (0,01) | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | 0,00 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | S/O | 0,08 |
| Contrats de change à terme | (0,27) | (0,77) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,65 | 0,12 |
| Titres vendus à découvert | (5,28) | (6,99) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (35,47) | 1,89 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | | | AES Corp. | | | |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. | | | | Santander Holdings USA, Inc. | 30 | 30 | 0,57 | 5,450 % éch. 01/06/2028 | \$ 20 | \$ 20 | 0,38 |
| 7,455 % éch. 08/11/2030 | \$ 20 | \$ 20 | 0,38 | 5,807 % éch. 09/09/2026 | | | | Clearway Energy Operating LLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETTS PRIVÉS | | | | | | | | 3,750 % éch. 15/02/2031 | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | | | | | Duke Energy Florida LLC | | | |
| Aflac, Inc. | | | | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | 200 | 205 | 3,93 | 2,500 % éch. 01/12/2029 | 54 | 48 | 0,92 |
| 1,125 % éch. 15/03/2026 | 19 | 18 | 0,34 | 5,500 % éch. 09/03/2028 | | | | New York State Electric & Gas Corp. | 30 | 31 | 0,60 |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc. | | | | Toronto-Dominion Bank | 20 | 20 | 0,38 | 5,650 % éch. 15/08/2028 | | | |
| 2,950 % éch. 15/03/2034 | 14 | 12 | 0,23 | 5,264 % éch. 11/12/2026 | | | | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 54 | 48 | 0,92 |
| American Tower Corp. | | | | Wells Fargo & Co. | 50 | 50 | 0,95 | 1,900 % éch. 15/06/2028 | | | |
| 1,450 % éch. 15/09/2026 | 36 | 33 | 0,63 | 4,540 % éch. 15/08/2026 | | | | Verizon Communications, Inc. | 25 | 21 | 0,39 |
| Bank of America Corp. | | | | Weyerhaeuser Co. | 36 | 36 | 0,69 | 1,500 % éch. 18/09/2030 | | | |
| 2,456 % éch. 22/10/2025 | 52 | 51 | 0,98 | 4,750 % éch. 15/05/2026 | | | | Vodafone Group PLC | 18 | 14 | 0,27 |
| Bank of Nova Scotia | | | | | | | | 5,125 % éch. 04/06/2081 | | | |
| 6,378 % éch. 11/03/2024 | 48 | 48 | 0,92 | | | | | | | | |
| Citigroup, Inc. | | | | INDUSTRIE | | | | | | | |
| 6,075 % éch. 25/01/2026 | 50 | 50 | 0,96 | Ball Corp. | | | | | | | |
| (d) | | | | 2,875 % éch. 15/08/2030 | 16 | 14 | 0,27 | | | | |
| Corebridge Financial, Inc. | | | | Elevance Health, Inc. | | | | | | | |
| 3,850 % éch. 05/04/2029 | 18 | 17 | 0,33 | 2,550 % éch. 15/03/2031 | 28 | 24 | 0,46 | | | | |
| Deutsche Bank AG | | | | FactSet Research Systems, Inc. | 18 | 16 | 0,31 | | | | |
| 1,375 % éch. 10/06/2026 | € 25 | 27 | 0,52 | 3,450 % éch. 01/03/2032 | | | | | | | |
| Equinix, Inc. | | | | Ford Motor Co. | 10 | 10 | 0,19 | | | | |
| 1,000 % éch. 15/09/2025 | \$ 28 | 26 | 0,49 | 6,100 % éch. 19/08/2032 | | | | | | | |
| 1,550 % éch. 15/03/2028 | 30 | 26 | 0,49 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | | | | | | | |
| Equitable Financial Life Global Funding | | | | 1,875 % éch. 31/03/2028 | € 27 | 28 | 0,54 | | | | |
| 1,300 % éch. 12/07/2026 | 28 | 25 | 0,48 | HCA, Inc. | | | | | | | |
| Banque européenne d'investissement | | | | 3,625 % éch. 15/03/2032 | \$ 28 | 25 | 0,48 | | | | |
| 2,375 % éch. 24/05/2027 | 67 | 63 | 1,21 | Hilton Domestic Operating Co., Inc. | | | | | | | |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | | 3,625 % éch. 15/02/2032 | 20 | 17 | 0,32 | | | | |
| 4,387 % éch. 15/06/2027 | 49 | 48 | 0,92 | 3,750 % éch. 01/05/2029 | 18 | 17 | 0,33 | | | | |
| HAT Holdings LLC | | | | MSCI, Inc. | | | | | | | |
| 3,375 % éch. 15/06/2026 | 16 | 15 | 0,29 | 3,625 % éch. 01/09/2030 | 22 | 20 | 0,38 | | | | |
| HSBC Holdings PLC | | | | NTT Finance Corp. | | | | | | | |
| 5,750 % éch. 20/12/2027 | £ 16 | 21 | 0,40 | 0,082 % éch. 13/12/2025 | € 100 | 104 | 1,98 | | | | |
| Hudson Pacific Properties LP | | | | Nucor Corp. | | | | | | | |
| 5,950 % éch. 15/02/2028 | \$ 10 | 9 | 0,17 | 4,300 % éch. 23/05/2027 | \$ 10 | 10 | 0,19 | | | | |
| JPMorgan Chase & Co. | | | | S&P Global, Inc. | | | | | | | |
| 2,947 % éch. 24/02/2028 | 52 | 49 | 0,94 | 4,750 % éch. 01/08/2028 | 48 | 49 | 0,94 | | | | |
| 6,070 % éch. 22/10/2027 | 50 | 51 | 0,98 | VMware LLC | | | | | | | |
| Manulife Financial Corp. | | | | 3,900 % éch. 21/08/2027 | 18 | 17 | 0,33 | | | | |
| 3,703 % éch. 16/03/2032 | 26 | 24 | 0,46 | Walt Disney Co. | | | | | | | |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | | | 2,200 % éch. 13/01/2028 | 52 | 48 | 0,92 | | | | |
| 3,741 % éch. 07/03/2029 | 50 | 48 | 0,92 | Warnermedia Holdings, Inc. | | | | | | | |
| Mizuho Financial Group, Inc. | | | | 4,054 % éch. 15/03/2029 | 28 | 27 | 0,52 | | | | |
| 0,214 % éch. 07/10/2025 | € 100 | 105 | 2,01 | Western Digital Corp. | | | | | | | |
| 3,490 % éch. 05/09/2027 | 100 | 111 | 2,13 | 4,750 % éch. 15/02/2026 | 16 | 16 | 0,31 | | | | |
| NatWest Group PLC | | | | Xylem, Inc. | | | | | | | |
| 4,067 % éch. 06/09/2028 | 100 | 113 | 2,17 | 1,950 % éch. 30/01/2028 | 30 | 27 | 0,52 | | | | |
| Pacific Life Global Funding | | | | | | | | | | | |
| 1,375 % éch. 14/04/2026 | \$ 19 | 18 | 0,34 | | | | | | | | |
| Radian Group, Inc. | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | 469 | 8,99 | | | | |
| | | | | | | | | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| | | | | | | | | St. Paul's CLO DAC | | | |
| | | | | | | | | 4,715 % éch. 15/01/2032 | | | |
| | | | | | | | | € 99 | | | |
| | | | | | | | | 109 | | | |
| | | | | | | | | 2,08 | | | |
| | | | | | | | | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| | | | | | | | | BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | |
| | | | | | | | | 5,364 % éch. 16/04/2024 | | | |
| | | | | | | | | (a)(b) | | | |
| | | | | | | | | \$ 400 | | | |
| | | | | | | | | 394 | | | |
| | | | | | | | | 7,55 | | | |
| | | | | | | | | Total des Instruments à court terme | | | |
| | | | | | | | | 394 | | | |
| | | | | | | | | 7,55 | | | |
| | | | | | | | | Total des Valeurs mobilières | | | |
| | | | | | | | | \$ 5 199 | | | |
| | | | | | | | | 99,58 | | | |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|----------------------|---------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 1 | \$ (2) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 1 | (5) | (0,10) |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars | Court | 03/2024 | 2 | (1) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 8 | (21) | (0,39) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 2 | (1) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 2 | (23) | (0,45) |
| | | | | \$ (53) | (1,02) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (53) | (1,02) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,000 % | 21/06/2025 | CAD 500 | \$ 1 | 0,02 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | AUD 600 | 11 | 0,21 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | € 100 | 6 | 0,12 |
| | | | | | \$ 18 | 0,35 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 18 | 0,35 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 40 | ¥ 5 961 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,02 |
| BRC | 01/2024 | € 5 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 5 | AUD 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 41 | ¥ 6 000 | 2 | 0 | 2 | 0,04 |
| CBK | 03/2024 | 46 | BRL 228 | 1 | 0 | 1 | 0,02 |
| GLM | 01/2024 | 17 | AUD 26 | 1 | 0 | 1 | 0,02 |
| MBC | 01/2024 | € 608 | \$ 668 | 0 | (3) | (3) | (0,06) |
| UAG | 01/2024 | £ 22 | 28 | 0 | (1) | (1) | (0,02) |
| | | | | \$ 5 | \$ (4) | \$ 1 | 0,02 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et Institutions en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ 1 | € 1 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 2 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 87 | 79 | 1 | 0 | 1 | 0,02 |
| MY1 | 01/2024 | 86 | 79 | 1 | 0 | 1 | 0,02 |
| SCX | 01/2024 | 2 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 86 | 78 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | 0,04 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 7 | £ 5 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 3 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 2 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 88 | 70 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 79 | 63 | 1 | 0 | 1 | 0,02 |
| UAG | 01/2024 | 88 | 70 | 1 | 0 | 1 | 0,02 |
| | | | | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | 0,04 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 5 0,10

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % éch. 01/02/2054 | \$ 100 | \$ (100) | (1,92) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (100) | (1,92) |
| Total des Investissements | | \$ 5 069 | 97,09 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ 152 | 2,91 |
| Actifs nets | | \$ 5 221 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund (suite)

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
 (b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
 (c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
 (d) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,99 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|-------|--------------|---------------------|
| Citigroup, Inc. | 6,075 % | 25/01/2026 | 27/07/2022 | \$ 49 | \$ 50 | 0,96 |

Un montant en numéraire de 69 \$ (31 décembre 2022 : 31 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-----------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 5 199 | \$ 0 | \$ 5 199 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (8) | (22) | 0 | (30) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (100) | 0 | (100) |
| Totaux | \$ (8) | \$ 5 077 | \$ 0 | \$ 5 069 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-----------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 5 070 | \$ 0 | \$ 5 070 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (4) | (41) | 0 | (45) |
| Totaux | \$ (4) | \$ 5 029 | \$ 0 | \$ 5 025 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | \$ 4 | \$ 0 | \$ 4 |
| BRC | 2 | 0 | 2 | (8) | 0 | (8) |
| CBK | 1 | 0 | 1 | (8) | 0 | (8) |
| GLM | 1 | 0 | 1 | 2 | 0 | 2 |
| MBC | (2) | 0 | (2) | S/O | S/O | S/O |
| MYI | 1 | 0 | 1 | (11) | 0 | (11) |
| SCX | 0 | 0 | 0 | (16) | 0 | (16) |
| SSB | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 52,20 | 32,23 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 47,38 | 70,65 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (1,02) | (0,18) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,35 | 0,02 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,10 | (0,75) |
| Titres vendus à découvert | (1,92) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 0,38 | 1,53 |
| Obligations et billets privés | 39,09 | 34,48 |
| Agences du gouvernement américain | 37,13 | 5,49 |
| Obligations du Trésor américain | 13,35 | S/O |
| Titres adossés à des actifs | 2,08 | 2,12 |
| Instruments à court terme | 7,55 | 59,26 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (1,02) | (0,18) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,35 | 0,02 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Contrats de change à terme | 0,02 | (0,87) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,08 | 0,12 |
| Titres vendus à découvert | (1,92) | S/O |
| Autres actifs et passifs à court terme | 2,91 | (1,97) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | |
|----------------------------|---------|----------------------------|---------------------|----------------------------------|---------|----------------------------|---------------------|--|-------------------------------|----------------------------------|---------------------|-------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | ÉTATS-UNIS | | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | | |
| ACTIONS ORDINAIRES | | | | ÉNERGIE | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | |
| Antero Midstream Corp. | 129 400 | \$ 1 621 | 1,65 | Kinder Morgan, Inc. | 235 000 | \$ 4 145 | 4,21 | 5,490 % éch. | | | | |
| Antero Resources Corp. (b) | 37 700 | 855 | 0,87 | Marathon Oil Corp. | 74 500 | 1 800 | 1,83 | 20/02/2024 (c)(d)(f) | \$ 1 000 | \$ 993 | 1,01 | |
| Cheniere Energy, Inc. | 17 033 | 2 908 | 2,95 | Occidental Petroleum Corp. | 28 366 | 1 694 | 1,72 | 5,524 % éch. | 26 600 | 26 463 | 26,87 | |
| Chesapeake Energy Corp. | 35 200 | 2 708 | 2,75 | ONEOK, Inc. | 67 630 | 4 749 | 4,82 | 06/02/2024 (a)(c)(d) | | | | 46,72 |
| Devon Energy Corp. | 19 700 | 892 | 0,91 | Targa Resources Corp. | 52 700 | 4 578 | 4,65 | Total des Instruments à court terme | | 46 018 | 46,72 | |
| Diamondback Energy, Inc. | 13 000 | 2 016 | 2,05 | Williams Cos., Inc. | 132 500 | 4 615 | 4,68 | Total des Valeurs mobilières | \$ 88 045 | 89,39 | | |
| DTE Midstream LLC | 54 900 | 3 009 | 3,05 | | | 42 027 | 42,67 | | | | | |
| EnLink Midstream LLC | 322 200 | 3 918 | 3,98 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | ACTIONS | | | | |
| EQT Corp. | 57 700 | 2 231 | 2,26 | BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | | |
| Hess Midstream LP « A » | 9 110 | 288 | 0,29 | 5,363 % éch. 11/01/2024 | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | |
| | | | | (c)(d) | | | \$ 3 200 | 3 196 | 3,24 | PIMCO Select Funds plc - | | |
| | | | | 5,389 % éch. 16/01/2024 | | | 9 700 | 9 680 | 9,83 | Fonds PIMCO | | |
| | | | | 5,394 % éch. | | | 1 000 | 997 | 1,01 | US Dollar Short-Term | | |
| | | | | 23/01/2024 (c)(d)(f) | | | 4 700 | 4 689 | 4,76 | Floating NAV Fund (e) | | |
| | | | | 5,479 % éch. 18/01/2024 | | | | | | 970 224 | 9 668 | 9,82 |
| | | | | (c)(d) | | | | | | Total des Fonds d'investissement | \$ 9 668 | 9,82 |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net | |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-----------------------------|-------------------------|--|--|---------------------|------|
| SSB | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 631 | Billets du Trésor américain | 0,250 % éch. 31/07/2025 | \$ (644) | \$ 631 | \$ 631 | 0,64 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | | \$ (644) | \$ 631 | \$ 631 | 0,64 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|-------------------------|----------------------------|---|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| FAR | À recevoir | Index Alerian MLP Index | 376 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 709 | 14/08/2024 | \$ 0 | \$ (3) | \$ (3) | 0,00 |
| JPM | À recevoir | Index AMNAX Index | 6 575 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 5 198 | 03/04/2024 | 0 | (25) | (25) | (0,02) |
| | À recevoir | Index Alerian MLP Index | 5 127 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 9 672 | 16/10/2024 | 0 | (44) | (44) | (0,05) |
| | | | | | | | \$ 0 | \$ (72) | \$ (72) | (0,07) |

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|---------------------------------|----------------------------|---|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir | Energy Transfer LP | 224 369 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 3 096 | 17/01/2024 | \$ 0 | \$ (14) | \$ (14) | (0,02) |
| | À recevoir | Enterprise Products Partners LP | 235 770 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 6 213 | 17/01/2024 | 0 | (29) | (29) | (0,03) |
| | À recevoir | Western Gas Partners LP | 94 461 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 2 764 | 17/01/2024 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| | À recevoir | Energy Transfer LP | 257 320 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 3 551 | 16/10/2024 | 0 | (16) | (16) | (0,02) |
| | À recevoir | MPLX LP | 197 100 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 7 238 | 13/11/2024 | 0 | (33) | (33) | (0,03) |
| | À recevoir | Plains All American Pipeline LP | 115 556 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 1 751 | 13/11/2024 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| CBK | À recevoir | Energy Transfer LP | 205 784 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 2 840 | 16/10/2024 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| MYI | À recevoir | Plains All American Pipeline LP | 426 400 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 6 460 | 17/01/2024 | 0 | (31) | (31) | (0,03) |
| | À recevoir | Enterprise Products Partners LP | 25 000 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 659 | 16/10/2024 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | À recevoir | Western Gas Partners LP | 147 621 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 4 319 | 16/10/2024 | 0 | (19) | (19) | (0,02) |
| | | | | | | | \$ 0 | \$ (179) | \$ (179) | (0,18) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 113 | £ 89 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | CAD 678 | \$ 501 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| MYI | 01/2024 | \$ 67 | € 61 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 1 | \$ (13) | \$ (12) | (0,01) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 556 | \$ 1 700 | \$ 0 | \$ (18) | \$ (18) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 2 165 | € 1 980 | 23 | 0 | 23 | 0,02 |
| CBK | 01/2024 | € 562 | \$ 609 | 1 | (12) | (11) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 41 | € 38 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 78 | \$ 85 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 15 852 | € 14 424 | 85 | 0 | 85 | 0,09 |
| MYI | 01/2024 | 14 742 | 13 413 | 77 | 0 | 77 | 0,08 |
| UAG | 01/2024 | 13 557 | 12 325 | 61 | 0 | 61 | 0,06 |
| | | | | \$ 248 | \$ (31) | \$ 217 | 0,22 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 94 | £ 74 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 105 | 83 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 2 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 26 | \$ 33 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | \$ 34 | £ 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 608 | 481 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | 398 | 316 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 4 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 608 | £ 480 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | \$ 15 | \$ (1) | \$ 14 | 0,01 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (32) (0,03)

Total des Investissements

\$ 98 312 99,82

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 181 0,18

Actifs nets

\$ 98 493 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 475 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 970 \$ (31 décembre 2022 : 2 870 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques | | Autres données significatives observables | Données significatives non observables | Juste valeur |
|---|--|------------------|---|--|--------------|
| | (Niveau 1) | (Niveau 2) | | | |
| Valeurs mobilières | \$ 42 027 | \$ 46 018 | \$ 0 | \$ 88 045 | |
| Fonds d'investissement | 9 668 | 0 | 0 | 9 668 | |
| Contrats de mise en pension | 0 | 631 | 0 | 631 | |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | (32) | 0 | (32) | |
| Totaux | \$ 51 695 | \$ 46 617 | \$ 0 | \$ 98 312 | |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 64 970 | \$ 41 989 | \$ 0 | \$ 106 959 |
| Fonds d'investissement | 11 833 | 0 | 0 | 11 833 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 811 | 0 | 811 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | 1 210 | 0 | 1 210 |
| Totaux | \$ 76 803 | \$ 44 010 | \$ 0 | \$ 120 813 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ (111) | \$ 475 | \$ 364 | \$ (129) | \$ 1 610 | \$ 1 481 |
| BPS | 6 | 0 | 6 | S/O | S/O | S/O |
| CBK | (24) | 0 | (24) | 488 | (370) | 118 |
| FAR | (3) | 0 | (3) | (18) | 550 | 532 |
| JPM | (69) | 410 | 341 | 18 | 0 | 18 |
| MBC | 71 | 0 | 71 | 305 | (310) | (5) |
| MYI | 24 | 560 | 584 | 17 | 710 | 727 |
| SCX | 5 | 0 | 5 | S/O | S/O | S/O |
| SOG | S/O | S/O | S/O | 466 | (270) | 196 |
| SSB | 4 | 0 | 4 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 65 | 0 | 65 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | S/O | S/O | S/O | 63 | 0 | 63 |

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 74,81 | 54,07 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 14,58 | 34,95 |
| Fonds d'investissement | 9,82 | 9,85 |
| Contrats de mise en pension | 0,64 | 0,68 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,03) | 1,01 |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Canada | S/O | 9,07 |
| États-Unis | 42,67 | 45,00 |
| Instruments à court terme | 46,72 | 34,95 |
| Fonds d'investissement | 9,82 | 9,85 |
| Contrats de mise en pension | 0,64 | 0,68 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,07) | (0,01) |
| Swaps de rendement total sur titres | (0,18) | (0,10) |
| Contrats de change à terme | (0,01) | 0,08 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,23 | 1,04 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 0,18 | (0,56) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETTS PRIVÉS | | | | | | | | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | | | | | | | | |
| SLM Student Loan Trust | | | | 5,500 % éch. 25/06/2035 - 25/02/2040 (a) | \$ 1 793 | \$ 356 | 0,04 | 0,628 % éch. 20/01/2035 - 20/08/2049 (a) | \$ 8 698 | \$ 700 | 0,08 |
| 4,475 % éch. 15/12/2033 | € 594 | \$ 609 | 0,06 | 5,620 % éch. 01/06/2041 | 461 | 481 | 0,05 | 0,728 % éch. 20/03/2035 - 20/09/2048 (a) | 1 949 | 233 | 0,03 |
| INDUSTRIE | | | | | | | | | | | |
| Times Square Hotel Trust | | | | 6,000 % éch. 25/07/2035 | 516 | 530 | 0,06 | 0,778 % éch. 20/07/2044 (a) | 2 278 | 380 | 0,04 |
| 8,528 % éch. 01/08/2026 | \$ 79 | 79 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/04/2032 - 25/03/2033 (a) | 268 | 38 | 0,00 | 0,927 % éch. 16/01/2038 (a) | 12 | 0 | 0,00 |
| Total Obligations et billets privés | | 688 | 0,07 | 6,000 % éch. 25/05/2035 | 690 | 703 | 0,08 | 0,977 % éch. 16/02/2040 (a) | 1 577 | 112 | 0,01 |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | | | | | | | | |
| Fannie Mae | | | | 6,500 % éch. 25/12/2034 (a) | 1 240 | 177 | 0,02 | 1,228 % éch. 20/05/2041 (a) | 1 202 | 83 | 0,01 |
| 0,000 % éch. 25/03/2033 - 25/03/2047 | 3 271 | 2 309 | 0,25 | 0,000 % éch. 15/10/2032 - 15/12/2043 | 4 165 | 3 021 | 0,33 | 2,500 % éch. 20/09/2027 (a) | 2 541 | 82 | 0,01 |
| 0,000 % éch. 25/05/2033 - 25/05/2048 (b)(d) | 3 866 | 2 970 | 0,32 | 0,000 % éch. 01/02/2035 - 15/08/2057 (b)(d) | 3 339 | 2 419 | 0,26 | 3,000 % éch. 20/12/2047 - 20/10/2051 | 7 061 | 6 455 | 0,70 |
| 0,000 % éch. 25/06/2043 - 25/02/2062 (a) | 240 084 | 6 095 | 0,66 | 0,000 % éch. 15/01/2038 - 15/08/2047 (a) | 19 181 | 1 284 | 0,14 | 3,000 % éch. 20/12/2049 - 20/01/2052 (a) | 18 760 | 2 643 | 0,29 |
| 0,200 % éch. 25/02/2043 (a) | 2 257 | 15 | 0,00 | 0,397 % éch. 15/02/2041 (a) | 253 | 19 | 0,00 | 3,250 % éch. 20/01/2047 | 435 | 389 | 0,04 |
| 0,206 % éch. 25/08/2033 | 241 | 221 | 0,02 | 0,437 % éch. 15/09/2043 (a) | 711 | 68 | 0,01 | 3,500 % éch. 20/09/2029 - 20/09/2046 (a) | 1 266 | 184 | 0,02 |
| 0,273 % éch. 25/08/2033 | 73 | 66 | 0,01 | 0,460 % éch. 25/08/2024 (a) | 48 930 | 119 | 0,01 | 3,500 % éch. 20/03/2042 - 20/01/2052 | 9 405 | 8 593 | 0,93 |
| 0,498 % éch. 25/04/2044 (a) | 1 416 | 164 | 0,02 | 0,497 % éch. 15/07/2041 (a) | 2 435 | 200 | 0,02 | 4,000 % éch. 15/04/2047 - 15/08/2048 | 2 305 | 2 250 | 0,24 |
| 0,548 % éch. 25/05/2046 - 25/01/2050 (a) | 18 884 | 2 508 | 0,27 | 0,547 % éch. 15/10/2041 - 15/05/2046 (a) | 27 727 | 3 236 | 0,35 | 4,500 % éch. 20/07/2040 - 20/02/2049 | 2 474 | 2 434 | 0,26 |
| 0,598 % éch. 25/10/2042 - 25/07/2059 (a) | 11 314 | 1 538 | 0,17 | 0,597 % éch. 15/08/2041 - 15/09/2044 (a) | 7 013 | 737 | 0,08 | 4,500 % éch. 20/05/2043 - 20/09/2047 (a) | 2 603 | 508 | 0,05 |
| 0,648 % éch. 25/06/2037 - 25/07/2050 (a) | 17 897 | 2 222 | 0,24 | 0,598 % éch. 25/11/2049 - 25/06/2050 (a) | 25 427 | 3 140 | 0,34 | 5,000 % éch. 20/06/2040 - 20/11/2048 | 2 798 | 2 834 | 0,31 |
| 0,698 % éch. 25/02/2046 - 25/09/2048 (a) | 8 050 | 1 070 | 0,12 | 0,647 % éch. 15/02/2044 (a) | 116 | 7 | 0,00 | 5,000 % éch. 20/09/2040 (a) | 402 | 0 | 0,00 |
| 0,748 % éch. 25/11/2047 - 25/06/2048 (a) | 27 945 | 3 581 | 0,39 | 0,648 % éch. 25/06/2050 (a) | 16 076 | 2 079 | 0,22 | 5,638 % éch. 20/09/2073 | 978 | 968 | 0,10 |
| 0,798 % éch. 25/04/2043 (a) | 1 778 | 120 | 0,01 | 0,697 % éch. 15/08/2025 - 15/10/2048 (a) | 11 772 | 1 316 | 0,14 | 6,000 % éch. 20/02/2047 | 14 | 15 | 0,00 |
| 0,848 % éch. 25/05/2030 (a) | 1 264 | 65 | 0,01 | 0,698 % éch. 25/05/2050 (a) | 2 799 | 387 | 0,04 | 6,087 % éch. 20/02/2070 | 480 | 479 | 0,05 |
| 1,078 % éch. 25/01/2041 (a) | 505 | 69 | 0,01 | 0,747 % éch. 15/03/2048 (a) | 3 071 | 397 | 0,04 | 6,238 % éch. 20/07/2073 | 90 075 | 89 651 | 9,69 |
| 1,148 % éch. 25/09/2040 - 25/09/2042 (a) | 2 853 | 270 | 0,03 | 0,797 % éch. 15/09/2042 (a) | 844 | 71 | 0,01 | 6,288 % éch. 20/09/2073 | 4 455 | 4 447 | 0,48 |
| 1,198 % éch. 25/05/2034 (a) | 184 | 1 | 0,00 | 0,847 % éch. 15/10/2036 (a) | 939 | 76 | 0,01 | 6,298 % éch. 20/08/2073 | 9 674 | 9 665 | 1,04 |
| 1,348 % éch. 25/12/2032 (a) | 430 | 43 | 0,00 | 1,017 % éch. 15/11/2037 (a) | 203 | 16 | 0,00 | 6,343 % éch. 20/03/2058 | 80 | 80 | 0,01 |
| 1,500 % éch. 25/08/2037 (a) | 53 320 | 2 930 | 0,32 | 1,037 % éch. 15/01/2042 (a) | 5 515 | 633 | 0,07 | 6,438 % éch. 20/06/2073 | 611 | 616 | 0,07 |
| 1,648 % éch. 25/11/2033 - 25/10/2034 (a) | 616 | 36 | 0,00 | 1,147 % éch. 15/11/2041 (a) | 118 | 6 | 0,00 | 6,458 % éch. 20/08/2073 | 4 569 | 4 603 | 0,50 |
| 1,748 % éch. 25/10/2042 (a) | 402 | 56 | 0,01 | 1,197 % éch. 15/07/2026 (a) | 320 | 5 | 0,00 | Ginnie Mae, TBA | | | |
| 2,000 % éch. 25/07/2037 - 25/04/2052 (a) | 14 229 | 1 406 | 0,15 | 1,247 % éch. 15/09/2026 - 15/12/2042 (a) | 1 536 | 188 | 0,02 | 3,000 % éch. 01/02/2054 | 32 700 | 29 632 | 3,20 |
| 2,148 % éch. 25/11/2033 (a) | 40 | 3 | 0,00 | 1,277 % éch. 15/09/2039 (a) | 2 356 | 246 | 0,03 | 4,000 % éch. 01/02/2054 | 11 200 | 10 705 | 1,16 |
| 2,500 % éch. 25/12/2027 - 25/10/2052 (a) | 193 376 | 26 900 | 2,91 | 1,397 % éch. 15/03/2038 (a) | 398 | 33 | 0,00 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 6 120 | 5 979 | 0,65 |
| 3,000 % éch. 25/11/2027 - 25/10/2052 (a) | 198 785 | 31 545 | 3,41 | 2,000 % éch. 25/11/2050 - 15/06/2052 (a) | 21 986 | 2 592 | 0,28 | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 5 000 | 4 966 | 0,54 |
| 3,000 % éch. 01/02/2057 - 01/04/2059 | 12 878 | 11 351 | 1,23 | 2,065 % éch. 15/09/2032 | 239 | 232 | 0,03 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | |
| 3,000 % éch. 01/07/2060 (h) | 9 964 | 8 552 | 0,92 | 2,447 % éch. 15/12/2031 (a) | 46 | 5 | 0,00 | 2,500 % éch. 01/01/2033 - 01/09/2051 | 8 575 | 7 438 | 0,80 |
| 3,500 % éch. 25/02/2028 - 25/04/2053 (a) | 25 643 | 4 054 | 0,44 | 2,500 % éch. 15/11/2027 - 15/10/2052 (a) | 91 608 | 12 351 | 1,33 | 2,500 % éch. 01/09/2051 (h) | 8 794 | 7 561 | 0,82 |
| 3,510 % éch. 01/03/2029 | 1 096 | 1 056 | 0,11 | 2,920 % éch. 01/09/2036 | 1 315 | 1 095 | 0,12 | 3,000 % éch. 01/01/2038 - 01/07/2052 | 37 929 | 34 002 | 3,67 |
| 3,870 % éch. 01/07/2027 | 1 600 | 1 543 | 0,17 | 3,000 % éch. 15/03/2027 - 25/12/2051 (a) | 117 960 | 17 853 | 1,93 | 3,000 % éch. 01/02/2040 - 01/03/2050 (h) | 20 231 | 18 571 | 2,01 |
| 3,956 % éch. 01/08/2049 | 447 | 452 | 0,05 | 3,000 % éch. 15/12/2046 - 15/04/2049 (a) | 908 | 130 | 0,01 | 3,500 % éch. 01/02/2030 - 01/06/2052 | 32 432 | 30 644 | 3,31 |
| 4,000 % éch. 25/04/2032 (a) | 382 | 37 | 0,00 | 3,231 % éch. 25/12/2036 | 6 841 | 5 614 | 0,61 | 3,500 % éch. 01/11/2049 (h) | 9 371 | 8 801 | 0,95 |
| 4,000 % éch. 25/10/2040 - 25/06/2050 (a) | 24 856 | 4 141 | 0,45 | 3,314 % éch. 15/12/2027 (a) | 389 | 17 | 0,00 | 4,000 % éch. 01/02/2037 - 01/08/2049 | 16 407 | 15 904 | 1,72 |
| 4,000 % éch. 25/05/2050 | 2 039 | 1 867 | 0,20 | 3,439 % éch. 25/09/2024 | 6 100 | 5 758 | 0,62 | 4,000 % éch. 01/05/2048 (h) | 6 786 | 6 547 | 0,71 |
| 4,037 % éch. 25/05/2051 (a) | 2 722 | 426 | 0,05 | 3,500 % éch. 15/03/2029 - 15/10/2052 (a) | 67 081 | 11 822 | 1,28 | 4,500 % éch. 01/12/2038 - 01/07/2052 | 7 850 | 7 681 | 0,83 |
| 4,140 % éch. 01/04/2028 | 677 | 672 | 0,07 | 3,500 % éch. 01/01/2038 - 01/12/2046 | 873 | 824 | 0,09 | 4,500 % éch. 01/07/2053 (h) | 9 267 | 8 988 | 0,97 |
| 4,374 % éch. 01/02/2028 | 2 000 | 1 975 | 0,21 | 4,000 % éch. 15/10/2041 - 25/08/2050 (a) | 23 850 | 5 173 | 0,56 | 5,000 % éch. 01/06/2048 - 01/09/2053 | 1 271 | 1 273 | 0,14 |
| 4,385 % éch. 01/04/2033 | 718 | 714 | 0,08 | 4,000 % éch. 01/03/2046 - 01/04/2048 | 9 743 | 9 429 | 1,02 | 5,500 % éch. 01/05/2053 | 1 476 | 1 494 | 0,16 |
| 4,440 % éch. 01/06/2033 | 1 573 | 1 570 | 0,17 | 4,190 % éch. 01/05/2030 | 2 500 | 2 441 | 0,26 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 4,490 % éch. 01/04/2033 | 300 | 301 | 0,03 | 4,500 % éch. 15/02/2037 - 25/10/2051 (a) | 6 491 | 1 341 | 0,14 | 3,000 % éch. 01/02/2054 | 58 000 | 51 369 | 5,55 |
| 4,500 % éch. 25/06/2029 - 25/09/2046 (a) | 3 980 | 551 | 0,06 | 4,500 % éch. 15/11/2040 - 01/02/2048 | 1 151 | 1 134 | 0,12 | 4,500 % éch. 01/02/2039 - 01/02/2054 | 191 450 | 186 425 | 20,15 |
| 4,500 % éch. 01/11/2032 - 01/04/2059 | 6 126 | 6 029 | 0,65 | 4,660 % éch. 25/01/2031 | 2 200 | 2 197 | 0,24 | 5,000 % éch. 01/01/2039 - 01/02/2054 | 224 100 | 221 863 | 23,98 |
| 4,580 % éch. 01/08/2033 | 1 000 | 1 009 | 0,11 | 5,000 % éch. 15/05/2025 - 25/05/2048 (a) | 1 690 | 277 | 0,03 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 162 800 | 163 538 | 17,67 |
| 4,700 % éch. 01/04/2033 | 1 410 | 1 423 | 0,15 | 5,000 % éch. 01/03/2049 | 2 485 | 2 515 | 0,27 | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 221 000 | 226 466 | 24,48 |
| 4,990 % éch. 01/03/2031 | 499 | 513 | 0,06 | Ginnie Mae | | | | 7,000 % éch. 01/01/2054 | 58 600 | 60 410 | 6,53 |
| 5,000 % éch. 25/04/2034 - 25/12/2035 (a) | 675 | 114 | 0,01 | 0,000 % éch. 20/08/2033 - 20/01/2044 (b)(d) | 1 545 | 1 387 | 0,15 | 1 492 796 161,34 | | | |
| 5,000 % éch. 25/09/2035 (a) | 189 | 30 | 0,00 | 0,000 % éch. 20/05/2040 - 20/08/2047 (a) | 53 491 | 1 975 | 0,21 | | | | |
| 5,478 % éch. 25/07/2046 | 119 | 118 | 0,01 | 0,000 % éch. 20/11/2045 | 534 | 427 | 0,05 | | | | |
| 5,481 % éch. 01/12/2048 | 411 | 419 | 0,05 | 0,078 % éch. 20/09/2043 (a) | 960 | 22 | 0,00 | | | | |
| | | | | 0,248 % éch. 20/09/2045 (a) | 1 880 | 164 | 0,02 | | | | |
| | | | | 0,577 % éch. 16/04/2040 - 16/08/2042 (a) | 2 589 | 252 | 0,03 | | | | |

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|--|----------------------------------|------------------------------|----------|------|
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | | | | | | | | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e) | | | | 6,500 % éch. 25/11/2037 | \$ | 2 231 | \$ 804 | 0,09 | Stratton BTL Mortgage Funding PLC | £ | 3 000 | \$ 3 607 | 0,39 |
| 0,125 % éch. 15/07/2024 | \$ | 130 | \$ 128 | 0,01 | 6,500 % éch. 25/12/2037 | 5 240 | 2 252 | 0,24 | Stratton Mortgage Funding PLC | | | | |
| 0,125 % éch. 15/10/2024 (i) | 3 118 | 3 050 | 0,33 | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust | | 15 | 13 | 0,00 | 6,919 % éch. 25/09/2051 | 5 000 | 6 374 | 0,69 | |
| 0,250 % éch. 15/01/2025 | 2 858 | 2 774 | 0,30 | 5,500 % éch. 25/10/2021 | | | | | 7,221 % éch. 20/07/2060 | 2 200 | 2 802 | 0,30 | |
| 0,500 % éch. 15/04/2024 | 1 135 | 1 120 | 0,12 | DBGS Mortgage Trust | | | | | 7,721 % éch. 20/07/2060 | 2 500 | 3 185 | 0,34 | |
| 2,375 % éch. 15/01/2025 | 326 | 324 | 0,04 | 6,959 % éch. 15/06/2033 | 2 422 | 1 880 | 0,20 | 8,220 % éch. 12/03/2052 | 1 400 | 1 788 | 0,19 | | |
| | | 7 396 | 0,80 | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust | | | | | 8,221 % éch. 20/07/2060 | 3 600 | 4 586 | 0,50 | |
| | | | | 5,660 % éch. 19/10/2036 | 4 470 | 3 692 | 0,40 | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | Eurosail PLC | | | | | 5,033 % éch. 25/07/2035 | \$ | 1 534 | 703 | 0,08 |
| 1166 Avenue of the Americas Commercial Mortgage Trust | | | | 4,198 % éch. 13/03/2045 | € | 515 | 560 | 0,06 | 5,132 % éch. 25/05/2035 | 954 | 760 | 0,08 | |
| 5,690 % éch. 13/10/2037 | 2 000 | 1 570 | 0,17 | 4,419 % éch. 10/09/2044 | | 800 | 857 | 0,09 | 5,770 % éch. 25/02/2037 | 451 | 432 | 0,05 | |
| 225 Liberty Street Trust | | | | 5,889 % éch. 13/06/2045 | € | 1 673 | 1 826 | 0,20 | 5,910 % éch. 25/06/2037 | 283 | 229 | 0,02 | |
| 4,649 % éch. 10/02/2036 | 5 000 | 3 898 | 0,42 | 6,339 % éch. 13/06/2045 | | 309 | 365 | 0,04 | 5,975 % éch. 25/12/2034 | 1 622 | 1 476 | 0,16 | |
| American Home Mortgage Assets Trust | | | | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust | | | | | 6,478 % éch. 25/02/2034 | 7 | 7 | 0,00 | |
| 5,595 % éch. 25/03/2047 | 1 977 | 1 744 | 0,19 | 6,475 % éch. 25/07/2035 | \$ | 162 | 147 | 0,02 | Structured Asset Mortgage Investments Trust | | | | |
| American Home Mortgage Investment Trust | | | | Grifonas Finance PLC | | | | | 5,910 % éch. 25/09/2047 | 3 046 | 2 624 | 0,28 | |
| 5,883 % éch. 25/09/2035 | 560 | 304 | 0,03 | 4,212 % éch. 28/08/2039 | € | 813 | 877 | 0,09 | 6,010 % éch. 25/08/2035 | 474 | 417 | 0,05 | |
| 6,050 % éch. 25/11/2045 | 1 752 | 1 521 | 0,16 | GS Mortgage Securities Corp. Trust | | | | | 6,595 % éch. 19/12/2033 | 346 | 326 | 0,04 | |
| 6,500 % éch. 25/03/2047 | 1 153 | 819 | 0,09 | 4,579 % éch. 10/10/2032 | \$ | 5 821 | 5 412 | 0,58 | Structured Asset Securities Corp. | | | | |
| Angel Oak Mortgage Trust | | | | 6,859 % éch. 15/07/2031 | | 600 | 436 | 0,05 | 5,720 % éch. 25/07/2035 | 1 268 | 1 156 | 0,12 | |
| 2,336 % éch. 25/04/2066 | 3 638 | 2 555 | 0,28 | 7,109 % éch. 15/07/2031 | | 2 000 | 1 250 | 0,14 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | | |
| Ashford Hospitality Trust | | | | GS Mortgage Securities Trust | | | | | 5,720 % éch. 25/05/2036 | 1 918 | 1 556 | 0,17 | |
| 8,284 % éch. 15/06/2035 | 6 900 | 6 666 | 0,72 | 3,805 % éch. 10/10/2035 | 3 700 | 3 060 | 0,33 | Tower Bridge Funding PLC | | | | | |
| Atlas Funding PLC | | | | GSMPS Mortgage Loan Trust | | | | | 0,000 % éch. 20/01/2066 (c) £ | 4 100 | 5 236 | 0,57 | |
| 6,920 % éch. 25/07/2058 | € | 1 150 | 1 466 | 5,870 % éch. 25/04/2036 | | 327 | 269 | 0,03 | Trinity Square PLC | | | | |
| 7,470 % éch. 25/07/2058 | 950 | 1 212 | 0,13 | 7,060 % éch. 20/10/2032 | | 1 094 | 977 | 0,11 | 6,920 % éch. 15/07/2059 | 3 200 | 4 067 | 0,44 | |
| Avon Finance PLC | | | | GSMSC Resecuritization Trust | | | | | 7,220 % éch. 15/07/2059 | 2 400 | 3 039 | 0,33 | |
| 0,000 % éch. 28/12/2049 | 2 000 | 2 544 | 0,27 | 2,167 % éch. 26/04/2037 | 7 355 | 1 939 | 0,21 | 7,970 % éch. 15/07/2059 | 1 600 | 2 025 | 0,22 | | |
| Banc of America Funding Trust | | | | Hops Hill PLC | | | | | Tudor Rose Mortgages | | | | |
| 6,263 % éch. 25/10/2036 | \$ | 1 587 | 1 360 | 7,048 % éch. 27/05/2054 | € | 3 000 | 3 822 | 0,41 | 6,370 % éch. 20/06/2048 | 5 105 | 6 325 | 0,68 | |
| Barley Hill PLC | | | | 7,548 % éch. 27/05/2054 | | 1 100 | 1 400 | 0,15 | 6,720 % éch. 20/06/2048 | 9 746 | 11 982 | 1,29 | |
| 6,898 % éch. 27/08/2058 | € | 2 953 | 3 670 | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | | | Twin Bridges PLC | | | | |
| BCAP LLC Trust | | | | 6,430 % éch. 25/07/2035 | \$ | 988 | 948 | 0,10 | 6,920 % éch. 01/12/2055 | 3 007 | 3 609 | 0,39 | |
| 5,750 % éch. 25/04/2037 | \$ | 1 440 | 1 311 | IndyMac Mortgage Loan Trust | | | | | Uropa Securities PLC | | | | |
| Bear Stearns ALT-A Trust | | | | 3,860 % éch. 25/12/2035 | | 3 002 | 1 716 | 0,19 | 5,590 % éch. 10/10/2040 | 64 | 79 | 0,01 | |
| 6,595 % éch. 25/01/2035 | 1 321 | 1 224 | 0,13 | 4,265 % éch. 25/12/2035 | | 318 | 240 | 0,03 | 5,690 % éch. 10/10/2040 | 32 | 37 | 0,00 | |
| Cascade Funding Mortgage Trust | | | | 5,870 % éch. 25/10/2036 | | 3 099 | 2 769 | 0,30 | Verus Securitization Trust | | | | |
| 4,000 % éch. 25/10/2068 | 719 | 720 | 0,08 | JPMorgan Alternative Loan Trust | | | | | 2,338 % éch. 25/10/2063 | \$ | 1 250 | 1 078 | 0,12 |
| Chase Mortgage Finance Trust | | | | 5,790 % éch. 25/11/2036 | 4 031 | 3 383 | 0,37 | 3,195 % éch. 25/10/2063 | 1 000 | 805 | 0,09 | | |
| 4,114 % éch. 25/03/2037 | 47 | 44 | 0,00 | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust | | | | | 4,199 % éch. 25/10/2063 | 1 000 | 773 | 0,08 | |
| ChaseFlex Trust | | | | 5,350 % éch. 05/07/2033 | 1 950 | 1 426 | 0,15 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | | |
| 6,150 % éch. 25/05/2037 | 1 420 | 1 353 | 0,15 | 6,039 % éch. 12/02/2051 | 52 | 434 | 0,05 | 3,814 % éch. 25/06/2037 | 2 974 | 2 547 | 0,28 | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | JPMorgan Resecuritization Trust | | | | | 4,272 % éch. 25/12/2036 | 2 153 | 1 878 | 0,20 | |
| 6,000 % éch. 25/12/2035 | 1 111 | 1 066 | 0,12 | 4,500 % éch. 26/04/2037 | 931 | 439 | 0,05 | 5,782 % éch. 25/04/2047 | 58 | 47 | 0,01 | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | 5,559 % éch. 26/09/2037 | 1 247 | 919 | 0,10 | 5,972 % éch. 25/09/2046 | 901 | 716 | 0,08 | | |
| 5,891 % éch. 25/08/2035 | 13 | 12 | 0,00 | Lehman Mortgage Trust | | | | | 6,262 % éch. 25/01/2047 | 656 | 580 | 0,06 | |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust | | | | 6,000 % éch. 25/12/2036 | 1 411 | 1 151 | 0,12 | 6,512 % éch. 25/11/2046 | 295 | 260 | 0,03 | | |
| 6,000 % éch. 25/11/2036 | 818 | 739 | 0,08 | Lehman XS Trust | | | | | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | |
| 6,000 % éch. 25/01/2037 | 1 412 | 1 149 | 0,12 | 5,950 % éch. 25/06/2047 | 5 266 | 4 669 | 0,50 | 6,002 % éch. 25/06/2046 | 1 941 | 1 515 | 0,16 | | |
| Countrywide Alternative Loan Trust | | | | MASTR Asset Securitization Trust | | | | | Worldwide Plaza Trust | | | | |
| 5,500 % éch. 25/06/2035 | 134 | 101 | 0,01 | 6,000 % éch. 25/10/2036 | 651 | 532 | 0,06 | 3,596 % éch. 10/11/2036 | 3 950 | 844 | 0,09 | | |
| 5,500 % éch. 25/07/2035 | 1 990 | 1 402 | 0,15 | MASTR Reperforming Loan Trust | | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 25/10/2035 | 1 105 | 809 | 0,09 | 7,000 % éch. 25/07/2035 | 1 190 | 825 | 0,09 | | | | | | |
| 5,500 % éch. 25/11/2035 | 1 643 | 928 | 0,10 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 25/12/2035 | 232 | 163 | 0,02 | 6,250 % éch. 25/08/2036 | 4 079 | 1 697 | 0,18 | Accredited Mortgage Loan Trust | | | | | |
| 5,790 % éch. 25/02/2047 | 269 | 250 | 0,03 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | | | | | | |
| 5,790 % éch. 25/09/2047 | 7 | 7 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/11/2035 | 965 | 624 | 0,07 | 6,490 % éch. 25/07/2035 | 2 150 | 1 979 | 0,21 | | |
| 5,892 % éch. 20/03/2046 | 470 | 382 | 0,04 | 6,000 % éch. 25/10/2037 | 6 307 | 3 287 | 0,36 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | | |
| 5,892 % éch. 20/05/2046 | 1 749 | 1 475 | 0,16 | Mortgage Equity Conversion Asset Trust | | | | | | | | | |
| 5,952 % éch. 25/06/2046 | 1 983 | 1 612 | 0,17 | 5,290 % éch. 25/02/2042 | 449 | 439 | 0,05 | 6,445 % éch. 25/11/2033 | 644 | 628 | 0,07 | | |
| 6,000 % éch. 25/05/2036 | 3 384 | 1 938 | 0,21 | Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust | | | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 25/02/2037 | 1 381 | 577 | 0,06 | 4,389 % éch. 25/10/2035 | 906 | 498 | 0,05 | Aegis Asset-Backed Securities Trust | | | | | |
| 6,012 % éch. 25/12/2035 | 1 200 | 1 056 | 0,11 | 6,017 % éch. 25/06/2037 | 1 216 | 1 018 | 0,11 | 6,470 % éch. 25/03/2035 | 50 | 46 | 0,00 | | |
| 6,110 % éch. 25/11/2035 | 3 651 | 2 915 | 0,31 | Nomura Resecuritization Trust | | | | | | | | | |
| 6,170 % éch. 25/09/2035 | 1 697 | 1 516 | 0,16 | 6,417 % éch. 26/11/2036 | 1 941 | 1 653 | 0,18 | Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates | | | | | |
| 6,250 % éch. 25/05/2036 | 265 | 146 | 0,02 | Residential Accredit Loans, Inc. Trust | | | | | | | | | |
| 6,250 % éch. 25/09/2037 | 509 | 343 | 0,04 | 5,770 % éch. 25/08/2036 | 797 | 592 | 0,06 | 7,300 % éch. 25/12/2034 | 991 | 867 | 0,09 | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates | | | | 5,929 % éch. 25/12/2035 | 1 146 | 521 | 0,06 | Ameritrust Mortgage Securities Trust | | | | | |
| 5,970 % éch. 25/03/2036 | 372 | 366 | 0,04 | 6,000 % éch. 25/01/2037 | 163 | 126 | 0,01 | 6,040 % éch. 25/04/2036 | 6 350 | 5 562 | 0,60 | | |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | 6,250 % éch. 25/01/2037 | 917 | 744 | 0,08 | Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | | |
| 3,695 % éch. 25/04/2035 | 201 | 139 | 0,01 | Residential Asset Securitization Trust | | | | | | | | | |
| 4,042 % éch. 20/04/2036 | 39 | 35 | 0,00 | 6,000 % éch. 25/12/2036 | 2 991 | 908 | 0,10 | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | | | |
| 4,441 % éch. 20/11/2035 | 3 131 | 2 828 | 0,31 | RMAC Securities PLC | | | | | | | | | |
| 4,524 % éch. 20/04/2036 | 541 | 473 | 0,05 | 5,509 % éch. 12/06/2044 | € | 349 | 429 | 0,05 | 3,646 % éch. 25/03/2036 | 1 593 | 1 367 | 0,15 | |
| 5,750 % éch. 25/07/2037 | 693 | 339 | 0,04 | Sestante Finance SRL | | | | | | | | | |
| | | | | 4,222 % éch. 23/07/2046 | € | 792 | 804 | 0,09 | 6,700 % éch. 25/02/2035 | 946 | 864 | 0,09 | |
| | | | | | | | | | Attentus CDO Ltd. | | | | |
| | | | | | | | | | 6,118 % éch. 11/10/2042 | 9 984 | 8 711 | 0,94 | |
| | | | | | | | | | Avoca Static CLO DAC | | | | |
| | | | | | | | | | 5,690 % éch. 15/10/2030 | € | 500 | 552 | 0,06 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | | Home Equity Asset Trust | | | | 5,746 % éch. 25/05/2036 | \$ 1 361 | \$ 665 | 0,07 |
| 5,543 % éch. 25/12/2035 | \$ 1 678 | \$ 1 497 | 0,16 | 5,790 % éch. 25/08/2036 | \$ 450 | \$ 447 | 0,05 | Residential Asset Mortgage Products Trust | | | |
| 5,653 % éch. 25/04/2036 | 1 458 | 1 450 | 0,16 | 5,950 % éch. 25/08/2037 | 695 | 689 | 0,07 | 6,010 % éch. 25/02/2036 | 196 | 187 | 0,02 |
| 5,950 % éch. 25/07/2036 | 238 | 237 | 0,03 | 6,145 % éch. 25/02/2036 | 1 414 | 1 366 | 0,15 | Residential Asset Securities Corp. Trust | | | |
| 6,520 % éch. 25/08/2037 | 7 854 | 6 835 | 0,74 | 6,760 % éch. 25/08/2033 | 271 | 257 | 0,03 | 5,712 % éch. 25/06/2034 | 654 | 642 | 0,07 |
| 6,670 % éch. 25/01/2045 | 25 | 25 | 0,00 | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | | | | 5,905 % éch. 25/06/2036 | 1 292 | 1 252 | 0,14 |
| 7,345 % éch. 25/07/2034 | 135 | 114 | 0,01 | 5,710 % éch. 25/04/2037 | 6 415 | 4 149 | 0,45 | 6,505 % éch. 25/08/2035 | 2 131 | 2 027 | 0,22 |
| Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC | | | | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | | Sapphire Aviation Finance Ltd. | | | |
| 7,147 % éch. 21/10/2028 | £ 3 200 | 4 086 | 0,44 | 4,433 % éch. 25/11/2036 | 186 | 168 | 0,02 | 4,250 % éch. 15/03/2040 | 3 160 | 2 817 | 0,30 |
| 8,097 % éch. 21/10/2028 | 8 775 | 11 132 | 1,20 | 5,590 % éch. 25/12/2036 | 5 797 | 3 096 | 0,33 | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | | | |
| Castlelake Aircraft Securitization Trust | | | | Jubilee CLO DAC | | | | 5,590 % éch. 25/09/2036 | 2 131 | 1 429 | 0,15 |
| 4,125 % éch. 15/06/2043 | \$ 1 875 | 1 712 | 0,19 | 4,615 % éch. 15/04/2031 | € 400 | 432 | 0,05 | Signal Peak CLO Ltd. | | | |
| Centerline Logistics Corp. | | | | Laurelin DAC | | | | 6,750 % éch. 25/04/2031 | 851 | 852 | 0,09 |
| 9,250 % éch. 15/12/2027 | 564 | 565 | 0,06 | 1,800 % éch. 20/10/2031 | 3 500 | 3 539 | 0,38 | SoFi Professional Loan Program LLC | | | |
| 9,750 % éch. 15/12/2027 | 703 | 704 | 0,08 | Lehman XS Trust | | | | 2,650 % éch. 25/09/2040 | 35 | 34 | 0,00 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | 5,890 % éch. 25/06/2046 | \$ 3 026 | 2 736 | 0,30 | Soundview Home Loan Trust | | | |
| 5,790 % éch. 25/12/2036 | 3 214 | 1 796 | 0,19 | Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | 5,640 % éch. 25/07/2037 | 5 508 | 4 707 | 0,51 |
| Conseco Finance Corp. | | | | 6,070 % éch. 25/02/2036 | 140 | 112 | 0,01 | 6,370 % éch. 25/10/2037 | 6 560 | 5 153 | 0,56 |
| 6,920 % éch. 01/12/2030 | 1 606 | 1 608 | 0,17 | 6,490 % éch. 25/08/2033 | 70 | 68 | 0,01 | 6,460 % éch. 25/06/2035 | 605 | 565 | 0,06 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates | | | | Man GLG Euro CLO DAC | | | | 6,770 % éch. 25/10/2037 | 5 206 | 3 812 | 0,41 |
| 5,910 % éch. 25/07/2034 | 2 421 | 2 364 | 0,26 | 1,680 % éch. 15/12/2031 | € 4 700 | 4 696 | 0,51 | Structured Asset Investment Loan Trust | | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 1,700 % éch. 15/10/2030 | 5 000 | 5 133 | 0,55 | 6,070 % éch. 25/04/2036 | 10 906 | 5 777 | 0,62 |
| 5,633 % éch. 25/06/2035 | 92 | 78 | 0,01 | MAPS Ltd. | | | | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| 5,690 % éch. 25/09/2037 | 1 886 | 1 922 | 0,21 | 4,212 % éch. 15/05/2043 | \$ 1 520 | 1 365 | 0,15 | 5,730 % éch. 25/05/2036 | 287 | 276 | 0,03 |
| 5,859 % éch. 25/10/2046 | 5 | 6 | 0,00 | MASTR Asset-Backed Securities Trust | | | | 6,595 % éch. 25/04/2035 | 56 | 55 | 0,01 |
| 5,910 % éch. 25/09/2047 | 878 | 846 | 0,09 | 6,050 % éch. 25/12/2035 | 63 | 62 | 0,01 | Taberna Preferred Funding Ltd. | | | |
| 6,170 % éch. 25/03/2036 | 1 742 | 1 519 | 0,16 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | 5,994 % éch. 05/05/2038 | 2 312 | 2 197 | 0,24 |
| 6,445 % éch. 25/01/2036 | 441 | 429 | 0,05 | 6,550 % éch. 25/10/2035 | 539 | 535 | 0,06 | 6,146 % éch. 05/07/2035 | 223 | 203 | 0,02 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. | | | | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | Terwin Mortgage Trust | | | |
| 6,445 % éch. 25/10/2034 | 70 | 69 | 0,01 | 3,938 % éch. 25/01/2035 | 740 | 657 | 0,07 | 6,415 % éch. 25/06/2036 | 200 | 195 | 0,02 |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC | | | | 5,610 % éch. 25/10/2036 | 996 | 430 | 0,05 | Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. | | | |
| 3,114 % éch. 25/05/2036 | 2 053 | 1 313 | 0,14 | 5,720 % éch. 25/07/2036 | 9 434 | 8 283 | 0,90 | 4,147 % éch. 15/09/2038 | 6 624 | 5 747 | 0,62 |
| 3,580 % éch. 25/03/2034 | 252 | 258 | 0,03 | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 3 401 | 1 271 | 0,14 | TIAA CLO Ltd. | | | |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust | | | | 5,970 % éch. 25/07/2036 | 3 401 | 1 282 | 0,14 | 6,805 % éch. 16/01/2031 | 1 952 | 1 953 | 0,21 |
| 3,541 % éch. 25/02/2037 | 2 870 | 1 776 | 0,19 | Morgan Stanley Capital, Inc. Trust | | | | Tralee CLO Ltd. | | | |
| Cumulus Static CLO DAC | | | | 6,050 % éch. 25/01/2036 | 1 729 | 1 658 | 0,18 | 7,577 % éch. 20/07/2029 | 4 100 | 4 109 | 0,44 |
| 5,499 % éch. 25/04/2033 | € 3 100 | 3 422 | 0,37 | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | | TruPS Financials Note Securitization Ltd. | | | |
| Elevation CLO Ltd. | | | | 5,570 % éch. 25/04/2037 | 136 | 71 | 0,01 | 7,202 % éch. 20/09/2039 | 2 207 | 2 157 | 0,23 |
| 7,505 % éch. 15/07/2029 | \$ 4 300 | 4 308 | 0,47 | Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust | | | | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | |
| First Franklin Mortgage Loan Trust | | | | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 3 532 | 1 423 | 0,15 | 5,890 % éch. 25/03/2037 | 1 039 | 1 021 | 0,11 |
| 6,130 % éch. 25/01/2036 | 311 | 308 | 0,03 | Nassau Ltd. | | | | | 200 483 | 21,67 | |
| Fremont Home Loan Trust | | | | 6,905 % éch. 15/01/2030 | 8 872 | 8 884 | 0,96 | Total des Valeurs mobilières | \$ 1 902 209 | 205,59 | |
| 5,750 % éch. 25/02/2037 | 5 655 | 4 330 | 0,47 | National Collegiate Student Loan Trust | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| 5,950 % éch. 25/08/2036 | 4 010 | 1 290 | 0,14 | 5,780 % éch. 25/05/2032 | 1 788 | 1 726 | 0,19 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 6,400 % éch. 25/07/2035 | 4 000 | 3 073 | 0,33 | Option One Mortgage Loan Trust | | | | PIMCO Select Funds plc | | | |
| Goodgreen Trust | | | | 5,610 % éch. 25/03/2037 | 4 624 | 4 085 | 0,44 | - Fonds PIMCO | | | |
| 3,930 % éch. 15/10/2053 | 1 830 | 1 619 | 0,18 | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | 425 | 4 | 0,00 |
| GSAA Home Equity Trust | | | | 7,045 % éch. 25/02/2035 | 298 | 286 | 0,03 | Total des Fonds d'investissement | \$ 4 | 0,00 | |
| 5,930 % éch. 25/04/2047 | 3 673 | 1 754 | 0,19 | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust | | | | | | | |
| 6,190 % éch. 25/10/2035 | 1 950 | 1 780 | 0,19 | 5,965 % éch. 25/07/2036 | 2 285 | 2 129 | 0,23 | | | | |
| GSAMP Trust | | | | 6,010 % éch. 25/05/2036 | 344 | 323 | 0,03 | | | | |
| 5,740 % éch. 25/03/2047 | 694 | 617 | 0,07 | Renaissance Home Equity Loan Trust | | | | | | | |
| Harvest CLO DAC | | | | 5,608 % éch. 25/05/2036 | 5 981 | 2 854 | 0,31 | | | | |
| 1,040 % éch. 15/07/2031 | € 800 | 837 | 0,09 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-----------------------------|--------------------|--|------------------|--|---------------------|
| | | | | | | | | | | En % de l'actif net |
| BPS | 5,470 % | 02/01/2024 | 03/01/2024 | \$ 31 800 | Billets du Trésor américain | \$ (32 494) | \$ 31 800 | \$ 31 805 | 3,44 | |
| | 5,510 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 100 | 1,250 % échéance 15/08/2031 | | | | | |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 1 668 | Billets du Trésor américain | (102) | 100 | 100 | 0,01 | |
| | | | | | 2,125 % échéance 15/05/2025 | | | | | |
| | 5,330 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 35 400 | Billets du Trésor américain | (1 702) | 1 668 | 1 668 | 0,18 | |
| | | | | | 4,875 % échéance 30/11/2025 | | | | | |
| | | | | | Billets du Trésor américain | (36 108) | 35 400 | 35 400 | 3,82 | |
| | | | | | 1,500 % échéance 30/11/2028 | | | | | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (70 406) | \$ 68 968 | \$ 68 973 | 7,45 | |

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 62 | \$ (41) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2025 | 18 | (28) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2024 | 62 | (11) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Long | 06/2024 | 98 | 14 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2024 | 62 | (127) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Long | 12/2025 | 9 | 16 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Fonds fédéraux à 30 jours février | Court | 02/2024 | 45 | 135 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 815 | (1 615) | (0,17) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 233 | (612) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 69 | 13 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 174 | (615) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 27 | (349) | (0,04) |
| | | | | \$ (3 220) | (0,35) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (3 220) | (0,35) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|------------------------|
| À recevoir ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 400 | \$ (67) | (0,01) |
| À payer ⁽¹⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 2 300 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,827 | 03/07/2028 | \$ 85 485 | (6 725) | (0,73) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 3 100 | (129) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,043 | 07/08/2028 | 14 800 | (277) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 17 500 | 998 | 0,11 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/06/2054 | 8 700 | 40 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,510 | 08/03/2033 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,740 | 10/07/2030 | 1 500 | 15 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 52 800 | 1 230 | 0,13 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 16 300 | (10) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,012 | 08/11/2030 | 14 100 | 527 | 0,06 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,180 | 08/11/2030 | 16 000 | 758 | 0,08 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,192 | 08/11/2030 | 4 500 | 217 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 2 400 | (26) | 0,00 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2029 | 19 900 | (102) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,320 | 10/10/2030 | 800 | 41 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 21/06/2024 | 200 400 | 955 | 0,10 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,250 | 18/03/2050 | € 2 400 | 988 | 0,11 |
| À recevoir ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 13 300 | (836) | (0,09) |
| À payer ⁽¹⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 21 500 | (13) | 0,00 |
| | | | | | \$ (2 415) | (0,26) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (2 415) | (0,26) |

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|------------------------|
| BOA | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,000 % | 28/05/2024 | 36 000 | \$ 43 | \$ 13 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,310 | 08/01/2024 | 6 700 | 49 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 1,010 | 23/01/2024 | 1 200 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 1,500 | 24/01/2024 | 1 000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 13/01/2025 | 28 000 | 189 | 72 | 0,01 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,000 | 22/04/2025 | 8 000 | 73 | 217 | 0,02 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,500 | 05/02/2024 | 76 000 | 509 | 737 | 0,08 |
| BRC | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,250 | 21/02/2024 | 30 500 | 31 | 1 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 21/02/2024 | 77 700 | 61 | 1 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,250 | 17/03/2025 | 8 000 | 44 | 73 | 0,01 |
| CBK | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 27/12/2024 | 28 400 | 119 | 68 | 0,01 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,400 | 19/05/2027 | 13 900 | 79 | 102 | 0,01 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,509 | 06/02/2024 | 7 200 | 35 | 87 | 0,01 |

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| DUB | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,500 % | 09/02/2024 | 24 700 | \$ 179 | \$ 259 | 0,03 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,500 | 20/02/2024 | 61 000 | 530 | 703 | 0,08 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,100 | 01/02/2024 | 30 000 | 68 | 157 | 0,02 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 16/12/2024 | 39 000 | 46 | 11 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,500 | 21/02/2025 | 4 800 | 44 | 57 | 0,01 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,500 | 19/08/2024 | 5 100 | 104 | 148 | 0,02 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,500 | 25/03/2025 | 16 300 | 329 | 620 | 0,07 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,045 | 08/01/2024 | 18 300 | 63 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,200 | 19/08/2024 | 5 100 | 104 | 29 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 1,016 | 23/01/2024 | 2 000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 1,953 | 21/02/2024 | 2 300 | 7 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 1,995 | 16/01/2024 | 10 400 | 101 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,040 | 11/01/2024 | 11 100 | 106 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,875 | 03/01/2024 | 1 400 | 37 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,500 | 07/02/2024 | 77 500 | 554 | 784 | 0,08 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,500 | 28/02/2024 | 35 500 | 288 | 444 | 0,05 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,500 | 04/03/2024 | 35 500 | 259 | 459 | 0,05 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,625 | 03/01/2024 | 1 400 | 38 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,250 | 29/11/2024 | 31 200 | 745 | 323 | 0,04 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 03/01/2025 | 22 000 | 130 | 54 | 0,01 |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 28/01/2025 | 1 400 | 8 | 4 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 26/04/2024 | 87 800 | 47 | 5 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,400 | 19/05/2027 | 20 000 | 107 | 147 | 0,02 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,250 | 19/08/2024 | 32 800 | 66 | 9 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,300 | 13/03/2025 | 17 000 | 31 | 8 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 18/03/2024 | 140 000 | 147 | 3 | 0,00 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,790 | 03/05/2024 | 14 800 | 322 | 70 | 0,01 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,790 | 03/05/2024 | 14 800 | 322 | 455 | 0,05 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,365 | 19/08/2024 | 5 500 | 102 | 135 | 0,01 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,265 | 19/08/2024 | 5 500 | 102 | 28 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,250 | 03/03/2025 | 44 000 | 70 | 22 | 0,00 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,500 | 28/02/2025 | 2 700 | 27 | 33 | 0,00 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,705 | 08/01/2024 | 1 200 | 5 | 19 | 0,00 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,000 | 16/04/2025 | 13 300 | 151 | 359 | 0,04 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 16/12/2024 | 14 600 | 61 | 33 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 13/01/2025 | 21 500 | 116 | 55 | 0,01 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,000 | 28/05/2024 | 43 100 | 49 | 15 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,000 | 14/06/2024 | 33 500 | 52 | 13 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,000 | 16/12/2024 | 16 800 | 28 | 10 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 14/05/2024 | 35 400 | 18 | 3 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 21/01/2025 | 49 500 | 54 | 15 | 0,00 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,750 | 21/03/2025 | 16 500 | 152 | 282 | 0,03 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,285 | 04/03/2024 | 8 500 | 160 | 78 | 0,01 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,548 | 06/02/2024 | 4 600 | 37 | 62 | 0,01 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,560 | 06/02/2024 | 7 700 | 37 | 107 | 0,01 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,905 | 06/02/2024 | 8 700 | 31 | 14 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,985 | 04/03/2024 | 8 500 | 160 | 20 | 0,00 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,433 | 27/02/2024 | 2 300 | 17 | 1 | 0,00 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,500 | 22/08/2025 | 17 000 | 211 | 287 | 0,03 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,000 | 16/04/2025 | 5 800 | 59 | 156 | 0,02 | |
| Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,000 | 22/04/2025 | 6 600 | 66 | 179 | 0,02 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 03/01/2025 | 9 600 | 45 | 24 | 0,00 | |
| Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,500 | 30/01/2025 | 14 000 | 66 | 39 | 0,00 | |
| | | | | | | | \$ 7 897 | \$ 8 109 | 0,88 |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|-------|--------------|---------------------|
| JPM | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/01/2054 | \$ 66,000 | 09/01/2024 | 37 000 | \$ 1 | \$ 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 75,000 | 09/01/2024 | 140 000 | 5 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/03/2054 | 75,000 | 06/03/2024 | 75 000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % éch. 01/03/2054 | 76,000 | 06/03/2024 | 20 000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,500 % éch. 01/02/2054 | 74,000 | 06/02/2024 | 100 000 | 4 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,500 % éch. 01/03/2054 | 79,000 | 06/03/2024 | 38 400 | 1 | 0 | 0,00 |
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | 70,000 | 06/02/2024 | 100 000 | 4 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 7,000 % éch. 01/02/2054 | 80,000 | 06/02/2024 | 41 600 | 2 | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ 21 | \$ 0 | 0,00 |

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,000 % | 13/01/2025 | 14 000 | \$ (105) | \$ (71) | (0,01) |
| DUB | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,600 | 01/02/2024 | 30 000 | (33) | (40) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,000 | 25/03/2025 | 16 300 | (185) | (371) | (0,04) |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 5,750 | 18/03/2024 | 140 000 | (68) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (391) | \$ (483) | (0,05) |

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | \$ 97,891 | 09/01/2024 | 2 000 | \$ (8) | \$ (23) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 98,813 | 09/01/2024 | 3 000 | (16) | (9) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % éch. 01/02/2054 | 101,094 | 06/02/2024 | 2 000 | (8) | (16) | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 96,828 | 09/01/2024 | 3 500 | (19) | (75) | (0,01) |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % éch. 01/02/2054 | 99,227 | 06/02/2024 | 1 000 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % éch. 01/02/2054 | 101,227 | 06/02/2024 | 1 000 | (4) | (7) | 0,00 |
| MSC | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 98,406 | 09/01/2024 | 1 000 | (5) | (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/02/2054 | 96,391 | 06/02/2024 | 10 000 | (30) | (14) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % éch. 01/02/2054 | 100,258 | 06/02/2024 | 7 000 | (38) | (49) | (0,01) |
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | 95,813 | 06/02/2024 | 2 000 | (11) | (9) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | 97,813 | 06/02/2024 | 2 000 | (10) | (11) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 97,078 | 09/01/2024 | 9 000 | (65) | (171) | (0,02) |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 97,945 | 09/01/2024 | 5 000 | (16) | (4) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 98,469 | 09/01/2024 | 2 000 | (9) | (13) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 98,813 | 09/01/2024 | 2 000 | (9) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 99,195 | 09/01/2024 | 14 300 | (53) | (36) | (0,01) |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 99,656 | 09/01/2024 | 9 000 | (21) | (10) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 99,906 | 09/01/2024 | 1 000 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/02/2054 | 96,813 | 06/02/2024 | 2 000 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/02/2054 | 98,313 | 06/02/2024 | 9 000 | (35) | (107) | (0,01) |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/02/2054 | 98,391 | 06/02/2024 | 9 000 | (37) | (103) | (0,01) |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/02/2054 | 100,813 | 06/02/2024 | 2 000 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,500 % éch. 01/02/2054 | 101,375 | 06/02/2024 | 8 000 | (16) | (11) | 0,00 |
| | | | | | \$ (426) | \$ (691) | (0,07) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 599 | \$ 758 | \$ 0 | \$ (6) | \$ (6) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 21 042 | \$ 22 955 | 0 | (294) | (294) | (0,03) |
| | 01/2024 | € 417 | € 386 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | £ 67 456 | \$ 85 371 | 0 | (625) | (625) | (0,07) |
| CBK | 01/2024 | \$ 504 | £ 398 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | € 102 | \$ 113 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 48 | £ 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 14 | \$ (925) | \$ (911) | (0,10) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ 9 850 | CAD 13 395 | \$ 309 | \$ 0 | \$ 309 | 0,04 |
| CBK | 01/2024 | 456 | 619 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 10 175 | 13 822 | 309 | 0 | 309 | 0,03 |
| MYI | 01/2024 | 56 | 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 9 970 | 13 524 | 287 | 0 | 287 | 0,03 |
| | | | | \$ 919 | \$ 0 | \$ 919 | 0,10 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 207 | \$ 243 | \$ 0 | \$ (3) | \$ (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 24 | CHF 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 10 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 497 | 430 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 925 | 810 | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 911 | 795 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 900 | 785 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | | | | \$ 121 | \$ (3) | \$ 118 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 446 | \$ 1 583 | \$ 0 | \$ (14) | \$ (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 356 | € 7 667 | 118 | (2) | 116 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 95 743 | 87 056 | 446 | 0 | 446 | 0,05 |
| CBK | 01/2024 | € 1 678 | \$ 1 828 | 2 | (28) | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 522 | € 4 120 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 235 | \$ 256 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 852 | € 1 693 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 95 685 | 87 056 | 504 | 0 | 504 | 0,05 |
| UAG | 01/2024 | 95 759 | 87 056 | 430 | 0 | 430 | 0,04 |
| | | | | \$ 1 548 | \$ (48) | \$ 1 500 | 0,15 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 653 | £ 515 | \$ 4 | \$ 0 | \$ 4 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 1 117 | 881 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 22 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 20 | \$ 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 379 | £ 298 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | £ 3 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 125 | 157 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 229 | £ 181 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 10 | \$ 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | \$ 6 412 | £ 5 070 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | 4 759 | 3 772 | 49 | 0 | 49 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | £ 3 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 412 | £ 5 067 | 47 | 0 | 47 | 0,01 |
| | | | | \$ 158 | \$ (1) | \$ 157 | 0,02 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 8 718 0,94

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Fannie Mae, TBA | | | |
| 4,000 % éch. 01/01/2039 | \$ 7 800 | (7 654) | (0,83) |
| Ginnie Mae, TBA | | | |
| 2,000 % éch. 01/01/2054 | 4 300 | (3 642) | (0,39) |
| 2,500 % éch. 01/01/2054 | 26 200 | (22 923) | (2,48) |
| 3,500 % éch. 01/01/2054 | 2 250 | (2 096) | (0,23) |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 2,000 % éch. 01/01/2039 | 22 800 | (20 445) | (2,21) |
| 2,000 % éch. 01/01/2054 | 33 750 | (27 591) | (2,98) |
| 2,000 % éch. 01/02/2054 | 102 600 | (83 972) | (9,08) |
| 2,500 % éch. 01/01/2054 | 9 000 | (7 658) | (0,83) |
| 2,500 % éch. 01/02/2054 | 96 500 | (82 213) | (8,88) |
| 3,000 % éch. 01/01/2039 | 500 | (471) | (0,05) |
| 3,000 % éch. 01/02/2054 (g) | 34 250 | (30 334) | (3,28) |
| 3,000 % éch. 01/03/2054 | 38 000 | (33 697) | (3,64) |
| 3,500 % éch. 01/02/2054 | 37 600 | (34 533) | (3,73) |
| 4,000 % éch. 01/01/2054 | 1 200 | (1 135) | (0,12) |
| 4,000 % éch. 01/02/2054 | 56 000 | (53 018) | (5,73) |
| 6,000 % éch. 01/02/2054 | 20 600 | (20 918) | (2,26) |
| Total des Titres vendus à découvert | \$ | (432 300) | (46,72) |
| Total des Investissements | \$ | 1 541 964 | 166,65 |
| Autres actifs et passifs à court terme | \$ | (616 708) | (66,65) |
| Actifs nets | \$ | 925 256 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre à principal uniquement.
- (c) Titre vendu avant l'émission.

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Les titres vendus à découvert au 31 décembre 2023 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 59 020 \$ (31 décembre 2022 : 324 164 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(i) Un titre d'une juste valeur globale de 821 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 1 837 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 4 656 \$) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 6 307 \$ (31 décembre 2022 : 4 327 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 460 \$ (31 décembre 2022 : 4 020 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 894 376 | \$ 7 833 | \$ 1 902 209 |
| Fonds d'investissement | 4 | 0 | 0 | 4 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 68 968 | 0 | 68 968 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | 3 083 | 0 | 3 083 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (432 300) | 0 | (432 300) |
| Totaux | \$ 4 | \$ 1 534 127 | \$ 7 833 | \$ 1 541 964 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 723 820 | \$ 1 179 | \$ 1 724 999 |
| Fonds d'investissement | 23 | 0 | 0 | 23 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 17 318 | 0 | 17 318 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | 26 778 | 0 | 26 778 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (518 212) | 0 | (518 212) |
| Totaux | \$ 23 | \$ 1 249 704 | \$ 1 179 | \$ 1 250 906 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BOS | 5,560 % | 13/12/2023 | 16/01/2024 | \$ (55 692) | \$ (55 855) | (6,04) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (55 855) | (6,04) |

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | En % de l'actif net |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|---|---------------------|
| BPG | 5,710 % | 28/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (822) | \$ (823) | (0,09) |
| Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (823) | (0,09) |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ (36) | \$ 0 | \$ (36) | \$ (3 187) | \$ 2 810 | \$ (377) |
| BPS | 775 | (600) | 175 | 3 438 | (3 310) | 128 |
| BRC | 273 | (370) | (97) | 500 | (480) | 20 |
| CBK | 1 187 | (1 300) | (113) | 11 235 | (10 950) | 285 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | 11 | 0 | 11 |
| DUB | 2 679 | (2 490) | 189 | 6 229 | (5 990) | 239 |
| FAR | 5 | 0 | 5 | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 1 202 | (1 050) | 152 | 1 201 | (1 080) | 121 |
| JPM | 438 | (340) | 98 | (743) | 730 | (13) |
| MBC | 14 | 0 | 14 | 2 699 | (2 490) | 209 |
| MSC | (70) | 0 | (70) | (94) | 0 | (94) |
| MYC | 1 305 | (1 250) | 55 | 2 285 | (2 410) | (125) |
| MYI | 539 | (1 070) | (531) | (6) | 0 | (6) |
| SAL | (490) | 460 | (30) | (418) | 480 | 62 |
| SCX | 50 | 0 | 50 | 1 971 | (1 850) | 121 |
| SSB | 49 | 0 | 49 | 4 | 0 | 4 |
| UAG | 798 | (1 320) | (522) | S/O | S/O | S/O |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 12,84 | 25,41 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 192,75 | 174,84 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 2,90 |
| Fonds d'investissement | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de mise en pension | 7,45 | 2,04 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,35) | 0,54 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,26) | (0,35) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,94 | 2,96 |
| Titres vendus à découvert | (46,72) | (61,03) |
| Contrats de prise en pension | (6,04) | (37,27) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (0,09) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 0,07 | 0,10 |
| Agences du gouvernement américain | 161,34 | 121,51 |
| Obligations du Trésor américain | 0,80 | 0,51 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 21,71 | 37,20 |
| Titres adossés à des actifs | 21,67 | 35,71 |
| Instruments à court terme | S/O | 8,12 |
| Fonds d'investissement | 0,00 | 0,00 |
| Contrats de mise en pension | 7,45 | 2,04 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,35) | 0,54 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,26) | (0,35) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,88 | 3,42 |
| Options sur titres | 0,00 | 0,00 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,05) | (1,08) |
| Options sur titres | (0,07) | (0,20) |
| Contrats de change à terme | (0,10) | 0,14 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,28 | 0,68 |
| Titres vendus à découvert | (46,72) | (61,03) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (66,65) | (47,31) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | | | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---------------------------------------|--|----------------------------------|------------------------------|---|--|--|------------------------------|--------|-------------------------|-------------------------|--|--------|--------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | INDUSTRIE | | | | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Nationwide Building Society | | | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | | | | | | | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | 5,264 % éch. 10/11/2026 | \$ | 900 | \$ 917 | 0,05 | 0,125 % éch. 15/07/2024 | 33 | 431 | 32 859 | 1,67 | | | | | |
| AerCap Ireland Capital DAC | | | | Nykredit Realkredit A/S | DKK | 42 597 | 6 334 | 0,32 | 5,456 % éch. 01/05/2038 | 163 | 167 | 0,01 | 0,125 % éch. 15/10/2024 | 23 | 984 | 23 463 | 1,20 | |
| 2,875 % éch. 14/08/2024 | \$ | 1 700 | \$ 1 668 | 0,09 | 5,000 % éch. 01/10/2053 | | | | 0,125 % éch. 15/04/2025 | 4 | 050 | 3 906 | 0,20 | 0,250 % éch. 15/01/2025 | 29 | 877 | 29 003 | 1,48 |
| American Honda Finance Corp. | | | | Royal Bank of Canada | | | | | (e) | 29 | 877 | 29 003 | 1,48 | 1,375 % éch. 15/07/2033 | 1 | 418 | 1 376 | 0,07 |
| 5,000 % éch. 23/05/2025 | | 4 100 | 4 114 | 0,21 | 4,851 % éch. 14/12/2026 | \$ | 9 400 | 9 475 | 0,48 | Billets du Trésor américain | | | | | | | | |
| American Tower Corp. | | | | 5,850 % éch. 18/03/2027 | £ | 5 400 | 6 883 | 0,35 | 0,375 % éch. 30/09/2027 | 100 | 88 | 0,00 | 0,500 % éch. 31/10/2027 | 1 | 200 | 1 055 | 0,05 | |
| 1,450 % éch. 15/09/2026 | | 8 200 | 7 476 | 0,38 | Sumitomo Mitsui Banking Corp. | | | | 0,625 % éch. 30/11/2027 | 12 | 800 | 11 284 | 0,58 | 0,625 % éch. 31/12/2027 | 10 | 700 | 9 410 | 0,48 |
| 3,800 % éch. 15/08/2029 | | 1 305 | 1 240 | 0,06 | 3,602 % éch. 16/02/2026 | € | 5 000 | 5 558 | 0,28 | 0,750 % éch. 31/01/2028 | 3 | 100 | 2 734 | 0,14 | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | | | | 5,900 % éch. 22/08/2024 | | | | | 245 Park Avenue Trust | | | | | | | | | |
| 4,675 % éch. 15/06/2026 | | 5 000 | 5 007 | 0,26 | Toronto-Dominion Bank | | | | 3,508 % éch. 05/06/2037 | 9 | 903 | 9 106 | 0,46 | Albion PLC | | | | |
| Banco BPM SpA | | | | 0,500 % éch. 03/04/2024 | | | | | American Home Mortgage Assets Trust | | | | | | | | | |
| 3,875 % éch. 18/09/2026 | € | 1 450 | 1 632 | 0,08 | 4,701 % éch. 05/06/2027 | \$ | 9 000 | 9 005 | 0,46 | 5,850 % éch. 25/09/2046 | \$ | 94 | 85 | 0,00 | American Home Mortgage Investment Trust | | | |
| Banco Santander Totta S.A. | | | | Toyota Motor Credit Corp. | | | | | 5,750 % éch. 25/03/2046 | | | | | | | | | |
| 3,750 % éch. 11/09/2026 | | 1 400 | 1 575 | 0,08 | 5,900 % éch. 22/08/2024 | | 4 700 | 4 705 | 0,24 | Ashford Hospitality Trust | | | | | | | | |
| Bank of America Corp. | | | | UniCredit SpA | € | 6 200 | 6 935 | 0,35 | 6,784 % éch. 15/04/2035 | 6 | 200 | 6 073 | 0,31 | Avon Finance PLC | | | | |
| 1,734 % éch. 22/07/2027 | \$ | 1 900 | 1 741 | 0,09 | 3,375 % éch. 31/01/2027 | | | | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| 2,015 % éch. 13/02/2026 | | 650 | 625 | 0,03 | Van Lanschot Kempen NV | | | | Banc of America Funding Trust | | | | | | | | | |
| 3,705 % éch. 24/04/2028 | | 100 | 96 | 0,01 | 3,500 % éch. 31/05/2026 | | 300 | 336 | 0,02 | 4,222 % éch. 26/10/2036 | | | | | | | | |
| 5,933 % éch. 15/09/2027 | | 8 500 | 8 677 | 0,44 | Wells Fargo & Co. | | | | 4,772 % éch. 25/05/2035 | | | | | | | | | |
| Bank of America N.A. | | | | 2,406 % éch. 30/10/2025 | \$ | 1 100 | 1 070 | 0,05 | 5,490 % éch. 20/02/2036 | | | | | | | | | |
| 5,650 % éch. 18/08/2025 | | 6 100 | 6 178 | 0,31 | 3,000 % éch. 23/10/2026 | | 600 | 570 | 0,03 | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | | | | | | | | |
| 6,171 % éch. 18/08/2025 | | 3 100 | 3 108 | 0,16 | 3,196 % éch. 17/06/2027 | | 3 700 | 3 539 | 0,18 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| Bank of Nova Scotia | | | | 3,584 % éch. 22/05/2028 | | 100 | 95 | 0,00 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| 3,050 % éch. 31/10/2024 | € | 5 000 | 5 501 | 0,28 | Wells Fargo Bank N.A. | | | | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| Barclays PLC | | | | 5,550 % éch. 01/08/2025 | | 6 400 | 6 469 | 0,33 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| 5,829 % éch. 09/05/2027 | \$ | 3 900 | 3 936 | 0,20 | 6,181 % éch. 01/08/2025 | | 3 500 | 3 511 | 0,18 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 6,496 % éch. 13/09/2027 | | 5 000 | 5 142 | 0,26 | | | 210 097 | 10,70 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| Citibank N.A. | | | | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES | | | | | | | | | | |
| 5,488 % éch. 04/12/2026 | | 2 600 | 2 648 | 0,14 | Alaska Airlines Pass-Through Trust | | | | NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | | | |
| 5,864 % éch. 29/09/2025 | | 11 200 | 11 391 | 0,58 | 4,800 % éch. 15/02/2029 | | 306 | 298 | 0,01 | 245 Park Avenue Trust | | | | | | | | |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A. | | | | American Airlines Pass-Through Trust | | | | | 3,508 % éch. 05/06/2037 | | | | | | | | | |
| 0,125 % éch. 16/12/2024 | € | 1 100 | 1 178 | 0,06 | 3,000 % éch. 15/04/2030 | | 134 | 121 | 0,01 | Albion PLC | | | | | | | | |
| Deutsche Bank AG | | | | 3,600 % éch. 22/03/2029 | | 129 | 121 | 0,01 | 0,000 % éch. 17/07/2066 | | | | | | | | | |
| 1,375 % éch. 17/02/2032 | | 10 000 | 9 094 | 0,46 | Carrier Global Corp. | € | 600 | 669 | 0,03 | American Home Mortgage Assets Trust | | | | | | | | |
| Deutsche Bank S.A. Espanola | | | | 4,375 % éch. 29/05/2025 | | | | | 5,850 % éch. 25/09/2046 | | | | | | | | | |
| 3,625 % éch. 23/11/2026 | | 600 | 675 | 0,03 | DAE Funding LLC | \$ | 2 800 | 2 585 | 0,13 | American Home Mortgage Investment Trust | | | | | | | | |
| Fédération des Caisses Desjardins du Québec | | | | 3,375 % éch. 20/03/2028 | | | | | 5,750 % éch. 25/03/2046 | | | | | | | | | |
| 5,147 % éch. 27/11/2028 | \$ | 9 400 | 9 643 | 0,49 | Imperial Brands Finance PLC | | | | | Ashford Hospitality Trust | | | | | | | | |
| 5,860 % éch. 30/11/2026 | £ | 700 | 892 | 0,05 | 3,125 % éch. 26/07/2024 | | 200 | 197 | 0,01 | 6,784 % éch. 15/04/2035 | | | | | | | | |
| GA Global Funding Trust | | | | 3,500 % éch. 26/07/2026 | | 3 243 | 3 096 | 0,16 | Avon Finance PLC | | | | | | | | | |
| 6,727 % éch. 11/04/2025 | \$ | 6 800 | 6 819 | 0,35 | Nissan Motor Co. Ltd. | | | | | 4,222 % éch. 26/10/2036 | | | | | | | | |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | | 3,522 % éch. 17/09/2025 | | 2 000 | 1 926 | 0,10 | 4,772 % éch. 25/05/2035 | | | | | | | | | |
| 1,431 % éch. 09/03/2027 | | 2 900 | 2 675 | 0,14 | 4,345 % éch. 17/09/2027 | | 1 600 | 1 532 | 0,08 | 5,490 % éch. 20/02/2036 | | | | | | | | |
| 1,948 % éch. 21/10/2027 | | 700 | 641 | 0,03 | Skyworks Solutions, Inc. | | | | | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 3,272 % éch. 29/09/2025 | | 700 | 688 | 0,04 | 1,800 % éch. 01/06/2026 | | 100 | 93 | 0,00 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 3,500 % éch. 01/04/2025 | | 800 | 782 | 0,04 | Spirit Airlines Pass-Through Trust | | | | | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 3,500 % éch. 16/11/2026 | | 2 300 | 2 216 | 0,11 | 4,100 % éch. 01/10/2029 | | 225 | 207 | 0,01 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 3,615 % éch. 15/03/2028 | | 1 000 | 959 | 0,05 | United Airlines Pass-Through Trust | | | | | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 5,798 % éch. 10/08/2026 | | 6 200 | 6 263 | 0,32 | 2,700 % éch. 01/11/2033 | | 167 | 141 | 0,01 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 6,451 % éch. 10/08/2026 | | 1 300 | 1 300 | 0,07 | 3,500 % éch. 01/09/2031 | | 380 | 347 | 0,02 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| HSBC Holdings PLC | | | | 5,875 % éch. 15/04/2029 | | 1 229 | 1 246 | 0,06 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| 5,887 % éch. 14/08/2027 | | 1 100 | 1 116 | 0,06 | Volkswagen Group of America Finance LLC | | | | | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| JPMorgan Chase & Co. | | | | 5,800 % éch. 12/09/2025 | | 2 450 | 2 471 | 0,13 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| 0,969 % éch. 23/06/2025 | | 600 | 586 | 0,03 | 6,333 % éch. 12/09/2025 | | 2 750 | 2 757 | 0,14 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 1,040 % éch. 04/02/2027 | | 1 100 | 1 011 | 0,05 | Warnermedia Holdings, Inc. | | | | | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 1,578 % éch. 22/04/2027 | | 1 800 | 1 662 | 0,08 | 3,638 % éch. 15/03/2025 | | 2 100 | 2 055 | 0,10 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 2,301 % éch. 15/10/2025 | | 700 | 682 | 0,03 | 3,755 % éch. 15/03/2027 | | 2 100 | 2 013 | 0,10 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | |
| 3,782 % éch. 01/02/2028 | | 700 | 677 | 0,03 | | | 21 875 | 1,11 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| 3,960 % éch. 29/01/2027 | | 2 200 | 2 150 | 0,11 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES | | | | | | | | | |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | | | | Georgia Power Co. | | | | | NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | | | |
| 5,110 % éch. 08/12/2026 | | 5 600 | 5 652 | 0,29 | 6,135 % éch. 08/05/2025 | | 4 900 | 4 912 | 0,25 | 245 Park Avenue Trust | | | | | | | | |
| Kookmin Bank | | | | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | | | | | 3,508 % éch. 05/06/2037 | | | | | | | | | |
| 4,000 % éch. 13/04/2027 | € | 1 300 | 1 477 | 0,08 | 6,051 % éch. 01/03/2025 | | 1 600 | 1 615 | 0,08 | Albion PLC | | | | | | | | |
| Morgan Stanley | | | | Pacific Gas & Electric Co. | | | | | 0,000 % éch. 17/07/2066 | | | | | | | | | |
| 1,512 % éch. 20/07/2027 | \$ | 2 800 | 2 559 | 0,13 | 3,000 % éch. 15/06/2028 | | 500 | 456 | 0,03 | American Home Mortgage Assets Trust | | | | | | | | |
| 2,188 % éch. 28/04/2026 | | 1 200 | 1 153 | 0,06 | | | 6 983 | 0,36 | American Home Mortgage Investment Trust | | | | | | | | | |
| 4,679 % éch. 17/07/2026 | | 400 | 396 | 0,02 | Total Obligations et billets privés | | 238 955 | 12,17 | Ashford Hospitality Trust | | | | | | | | | |
| 6,138 % éch. 16/10/2026 | | 300 | 306 | 0,02 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | Avon Finance PLC | | | | | | | | | |
| 6,296 % éch. 18/10/2028 | | 900 | 943 | 0,05 | Fannie Mae | | | | | 4,222 % éch. 26/10/2036 | | | | | | | | |
| Morgan Stanley Bank N.A. | | | | 0,928 % éch. 25/03/2037 | (a) | 222 | 19 | 0,00 | 4,772 % éch. 25/05/2035 | | | | | | | | | |
| 5,882 % éch. 30/10/2026 | | 4 100 | 4 217 | 0,21 | 2,915 % éch. 01/10/2025 | | 9 609 | 9 314 | 0,47 | 5,490 % éch. 20/02/2036 | | | | | | | | |
| Nationale-Nederlanden Bank NV | | | | 3,000 % éch. 25/10/2040 | | 623 | 585 | 0,03 | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |
| 3,625 % éch. 16/10/2026 | € | 1 100 | 1 241 | 0,06 | | | | | 5,820 % éch. 25/01/2034 | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Bear Stearns ALT-A Trust | | | | JPMorgan Mortgage Trust | | | | 6,630 % éch. 25/11/2045 | \$ 892 | \$ 815 | 0,04 |
| 4,170 % éch. 25/08/2036 | \$ 563 | \$ 387 | 0,02 | 4,319 % éch. 25/04/2036 | \$ 606 | \$ 536 | 0,03 | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust | | | |
| 4,228 % éch. 25/11/2036 | 3 186 | 1 763 | 0,09 | Jupiter Mortgage PLC | | | | 4,792 % éch. 25/04/2036 | 1 430 | 1 354 | 0,07 |
| 4,730 % éch. 25/09/2035 | 6 | 4 | 0,00 | 6,021 % éch. 20/07/2060 | £ 10 339 | 13 180 | 0,67 | | | 289 451 | 14,75 |
| 4,964 % éch. 25/01/2036 | 28 | 26 | 0,00 | Lehman XS Trust | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| 5,215 % éch. 25/07/2035 | 780 | 526 | 0,03 | 5,830 % éch. 25/11/2035 | \$ 2 980 | 2 868 | 0,15 | Aames Mortgage Investment Trust | | | |
| 7,045 % éch. 25/01/2035 | 1 481 | 1 388 | 0,07 | 5,830 % éch. 25/07/2037 | 8 948 | 8 199 | 0,42 | 6,385 % éch. 25/10/2035 | 2 900 | 2 733 | 0,14 |
| Bear Stearns Mortgage Funding Trust | | | | 6,010 % éch. 25/12/2035 | 4 310 | 3 997 | 0,20 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | |
| 5,810 % éch. 25/06/2047 | 323 | 273 | 0,01 | London Wall Mortgage Capital PLC | | | | 5,790 % éch. 25/10/2036 | 3 924 | 1 452 | 0,07 |
| 5,830 % éch. 25/10/2036 | 1 309 | 1 097 | 0,06 | 5,970 % éch. 15/05/2051 | £ 6 380 | 8 084 | 0,41 | Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust | | | | 6,020 % éch. 15/05/2052 | 4 740 | 6 015 | 0,31 | 6,050 % éch. 25/11/2035 | 3 026 | 2 756 | 0,14 |
| 3,993 % éch. 26/12/2046 | 443 | 335 | 0,02 | Luminant Mortgage Trust | | | | 6,385 % éch. 25/09/2035 | 6 000 | 5 565 | 0,28 |
| 4,805 % éch. 26/01/2036 | 1 536 | 1 137 | 0,06 | 5,870 % éch. 25/10/2046 | \$ 143 | 125 | 0,01 | 6,430 % éch. 25/10/2035 | 1 700 | 1 557 | 0,08 |
| Braemar Hotels & Resorts Trust | | | | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust | | | | AREIT LLC | | | |
| 6,354 % éch. 15/06/2035 | 116 | 116 | 0,01 | 5,812 % éch. 25/12/2046 | 9 191 | 6 783 | 0,35 | 7,470 % éch. 17/08/2041 | 500 | 501 | 0,03 |
| Brants Bridge PLC | | | | Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust | | | | Ares European CLO DAC | | | |
| 6,120 % éch. 14/06/2066 | £ 931 | 1 184 | 0,06 | 5,956 % éch. 15/06/2030 | 4 | 4 | 0,00 | 4,625 % éch. 15/10/2030 | € 1 139 | 1 249 | 0,06 |
| BX Trust | | | | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | 4,745 % éch. 15/10/2031 | 987 | 1 080 | 0,06 |
| 6,679 % éch. 15/05/2035 | \$ 7 010 | 6 901 | 0,35 | 4,757 % éch. 25/12/2034 | 4 | 4 | 0,00 | Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV | | | |
| Canada Square Funding PLC | | | | 5,890 % éch. 25/02/2036 | 6 | 5 | 0,00 | 4,553 % éch. 21/09/2031 | 784 | 869 | 0,04 |
| 6,000 % éch. 17/06/2058 | £ 2 157 | 2 738 | 0,14 | 5,930 % éch. 25/04/2029 | 100 | 93 | 0,00 | Asset-Backed Funding Certificates Trust | | | |
| Canterbury Finance PLC | | | | 5,970 % éch. 25/11/2035 | 3 | 2 | 0,00 | 5,790 % éch. 25/11/2036 | \$ 6 039 | 2 394 | 0,12 |
| 6,046 % éch. 16/05/2058 | 1 852 | 2 356 | 0,12 | 6,465 % éch. 25/12/2029 | 79 | 72 | 0,00 | Auto ABS French Leases FCT | | | |
| Citigroup Commercial Mortgage Trust | | | | Mortimer BTL PLC | | | | 4,615 % éch. 28/10/2035 | € 5 000 | 5 543 | 0,28 |
| 6,556 % éch. 15/12/2036 | \$ 1 000 | 991 | 0,05 | 0,000 % éch. 22/12/2056 | £ 1 000 | 1 278 | 0,06 | AutoFlorence SRL | | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | 5,920 % éch. 23/06/2053 | 416 | 528 | 0,03 | 4,826 % éch. 25/12/2046 | 1 500 | 1 666 | 0,09 |
| 5,322 % éch. 25/08/2035 | 52 | 44 | 0,00 | Pierpont BTL PLC | | | | Autonoria Spain | | | |
| 6,980 % éch. 25/05/2035 | 1 | 1 | 0,00 | 6,020 % éch. 22/12/2053 | 9 840 | 12 473 | 0,64 | 4,576 % éch. 30/09/2041 | 2 100 | 2 327 | 0,12 |
| 7,110 % éch. 25/10/2035 | 29 | 27 | 0,00 | Polaris PLC | | | | Avoca CLO DAC | | | |
| Countrywide Alternative Loan Trust | | | | 5,985 % éch. 23/12/2058 | 981 | 1 248 | 0,06 | 4,785 % éch. 15/10/2032 | 4 200 | 4 582 | 0,23 |
| 5,667 % éch. 20/12/2046 | 52 | 45 | 0,00 | Prime Mortgage Trust | | | | Avoca Static CLO DAC | | | |
| 5,670 % éch. 25/04/2047 | 1 438 | 1 349 | 0,07 | 5,870 % éch. 25/02/2034 | \$ 17 | 16 | 0,00 | 5,690 % éch. 15/10/2030 | 600 | 662 | 0,03 |
| 5,680 % éch. 25/04/2047 | 1 266 | 1 028 | 0,05 | Primrose Residential DAC | | | | Bain Capital Euro CLO DAC | | | |
| 5,750 % éch. 25/04/2037 | 572 | 475 | 0,02 | 4,626 % éch. 24/03/2061 | € 17 243 | 18 989 | 0,97 | 4,733 % éch. 20/01/2032 | 689 | 751 | 0,04 |
| 5,770 % éch. 25/06/2035 | 873 | 588 | 0,03 | Residential Accredited Loans, Inc. Trust | | | | Bavarian Sky S.A. | | | |
| 5,790 % éch. 25/02/2047 | 65 | 60 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/08/2036 | \$ 898 | 702 | 0,04 | 4,269 % éch. 20/03/2030 | 662 | 731 | 0,04 |
| 5,830 % éch. 25/05/2047 | 239 | 204 | 0,01 | Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust | | | | 4,309 % éch. 20/11/2031 | 1 100 | 1 216 | 0,06 |
| 5,890 % éch. 25/07/2046 | 3 512 | 3 067 | 0,16 | 5,091 % éch. 25/09/2035 | 434 | 290 | 0,01 | 4,559 % éch. 20/07/2029 | 1 424 | 1 574 | 0,08 |
| 6,012 % éch. 25/12/2035 | 613 | 508 | 0,03 | RMAC PLC | | | | Bavarian Sky UK PLC | | | |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | 0,000 % éch. 15/02/2047 | £ 2 000 | 2 558 | 0,13 | 5,818 % éch. 20/04/2031 | £ 4 500 | 5 752 | 0,29 |
| 5,930 % éch. 25/05/2035 | 2 971 | 2 379 | 0,12 | Sequoia Mortgage Trust | | | | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | | | |
| 6,250 % éch. 25/02/2035 | 3 146 | 2 677 | 0,14 | 6,072 % éch. 20/12/2034 | \$ 211 | 189 | 0,01 | 5,790 % éch. 25/08/2036 | \$ 418 | 400 | 0,02 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | Shamrock Residential DAC | | | | 5,810 % éch. 25/12/2036 | 1 000 | 964 | 0,05 |
| 0,098 % éch. 25/06/2032 | 0 | 0 | 0,00 | 4,726 % éch. 24/01/2061 | € 17 963 | 19 775 | 1,01 | 5,970 % éch. 25/05/2037 | 2 027 | 1 942 | 0,10 |
| 6,050 % éch. 25/03/2032 | 1 | 1 | 0,00 | Stratton Mortgage Funding PLC | | | | Betony CLO Ltd. | | | |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates | | | | 5,920 % éch. 12/12/2043 | £ 4 594 | 5 816 | 0,30 | 6,732 % éch. 30/04/2031 | 938 | 939 | 0,05 |
| 3,950 % éch. 27/12/2037 | 4 357 | 3 697 | 0,19 | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | | Black Diamond CLO DAC | | | |
| Credit Suisse Mortgage Capital Trust | | | | 5,790 % éch. 25/10/2035 | \$ 1 903 | 1 737 | 0,09 | 2,500 % éch. 15/05/2032 | 3 909 | 3 774 | 0,19 |
| 3,850 % éch. 25/09/2057 | 8 038 | 7 807 | 0,40 | 6,412 % éch. 25/01/2035 | 19 | 16 | 0,00 | 4,853 % éch. 20/01/2032 | € 605 | 664 | 0,03 |
| 6,194 % éch. 15/07/2032 | 385 | 368 | 0,02 | 6,478 % éch. 25/02/2034 | 9 | 8 | 0,00 | 4,982 % éch. 15/05/2032 | 21 788 | 23 765 | 1,22 |
| CSAIL Commercial Mortgage Trust | | | | Structured Asset Mortgage Investments Trust | | | | Blackrock European CLO DAC | | | |
| 3,504 % éch. 15/06/2057 | 4 030 | 3 900 | 0,20 | 5,830 % éch. 25/09/2047 | 587 | 526 | 0,03 | 4,635 % éch. 15/03/2031 | 740 | 811 | 0,04 |
| Dilosk RBMS DAC | | | | 5,970 % éch. 19/07/2035 | 13 | 12 | 0,00 | BlueMountain Fuji EUR CLO DAC | | | |
| 4,956 % éch. 20/10/2062 | € 1 223 | 1 357 | 0,07 | 6,030 % éch. 25/02/2036 | 8 | 6 | 0,00 | 4,615 % éch. 15/07/2030 | 276 | 304 | 0,02 |
| Dutch Property Finance BV | | | | 6,412 % éch. 25/12/2035 | 50 | 40 | 0,00 | Bumper BE NV/S.A. | | | |
| 4,602 % éch. 28/07/2058 | 2 760 | 3 042 | 0,15 | Thornburg Mortgage Securities Trust | | | | 4,576 % éch. 23/10/2031 | 5 053 | 5 591 | 0,28 |
| 4,652 % éch. 28/04/2059 | 10 155 | 11 182 | 0,57 | 6,110 % éch. 25/09/2043 | 304 | 286 | 0,01 | Bumper FR | | | |
| 5,702 % éch. 28/04/2050 | 9 579 | 10 384 | 0,53 | Towd Point Mortgage Trust | | | | 4,576 % éch. 27/04/2032 | 10 827 | 11 982 | 0,61 |
| GSR Mortgage Loan Trust | | | | 3,750 % éch. 25/10/2056 | 8 100 | 7 793 | 0,40 | Bumper NL BV | | | |
| 5,820 % éch. 25/01/2034 | \$ 0 | 0 | 0,00 | Tower Bridge Funding PLC | | | | 4,529 % éch. 22/03/2035 | 2 200 | 2 434 | 0,12 |
| HarborView Mortgage Loan Trust | | | | 0,000 % éch. 20/01/2066 (b) | £ 1 000 | 1 277 | 0,07 | 5,076 % éch. 24/06/2031 | 1 791 | 1 983 | 0,10 |
| 4,725 % éch. 19/08/2036 | 9 | 8 | 0,00 | 6,120 % éch. 21/07/2064 | 6 393 | 8 158 | 0,42 | Cairn CLO DAC | | | |
| 5,910 % éch. 19/05/2035 | 20 | 18 | 0,00 | Twin Bridges PLC | | | | 4,552 % éch. 30/04/2031 | 1 136 | 1 240 | 0,06 |
| Hilton Orlando Trust | | | | 5,990 % éch. 01/12/2055 | 7 149 | 9 046 | 0,46 | 4,618 % éch. 31/01/2030 | 422 | 462 | 0,02 |
| 6,709 % éch. 15/12/2034 | 9 170 | 9 093 | 0,46 | 6,170 % éch. 14/06/2055 | 846 | 1 077 | 0,05 | 4,745 % éch. 15/10/2031 | 600 | 652 | 0,03 |
| Hops Hill PLC | | | | 6,432 % éch. 15/05/2056 | 1 000 | 1 278 | 0,07 | Carlyle Euro CLO DAC | | | |
| 6,197 % éch. 21/12/2055 | £ 3 353 | 4 261 | 0,22 | Verus Securitization Trust | | | | 4,665 % éch. 15/01/2031 | 793 | 868 | 0,04 |
| Impac CMB Trust | | | | 1,829 % éch. 25/10/2066 | \$ 5 833 | 5 090 | 0,26 | 4,892 % éch. 15/08/2032 | 5 700 | 6 214 | 0,32 |
| 6,010 % éch. 25/05/2035 | \$ 3 149 | 2 885 | 0,15 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. | | | |
| 6,230 % éch. 25/10/2033 | 0 | 0 | 0,00 | 4,407 % éch. 25/08/2046 | 25 | 22 | 0,00 | 6,795 % éch. 15/07/2031 | \$ 6 272 | 6 265 | 0,32 |
| Independence Plaza Trust | | | | 4,615 % éch. 25/10/2035 | 219 | 196 | 0,01 | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC | | | |
| 3,911 % éch. 10/07/2035 | 4 300 | 4 059 | 0,21 | 5,712 % éch. 25/03/2047 | 1 945 | 1 611 | 0,08 | 4,925 % éch. 16/01/2033 | € 7 400 | 8 049 | 0,41 |
| JPMorgan Alternative Loan Trust | | | | 6,010 % éch. 25/12/2045 | 5 | 5 | 0,00 | | | | |
| 6,500 % éch. 25/03/2036 | 1 410 | 817 | 0,04 | 6,050 % éch. 25/10/2045 | 3 | 2 | 0,00 | | | | |
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust | | | | 6,390 % éch. 25/10/2044 | 408 | 386 | 0,02 | | | | |
| 6,826 % éch. 15/02/2035 | 6 201 | 6 127 | 0,31 | 6,450 % éch. 25/10/2045 | 1 689 | 1 574 | 0,08 | | | | |

Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. | € 799 | \$ 870 | 0,04 | 5,770 % éch. 25/09/2036 | \$ 2 744 | \$ 978 | 0,05 | 5,938 % éch. 12/04/2032 | € 12 639 | \$ 14 006 | 0,71 |
| Carlyle U.S. CLO Ltd. | \$ 3 757 | 3 756 | 0,19 | 5,950 % éch. 25/03/2046 | 503 | 487 | 0,02 | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | |
| 6,697 % éch. 20/04/2031 | | | | 6,370 % éch. 25/11/2035 | 1 550 | 1 465 | 0,07 | 6,790 % éch. 25/01/2036 | \$ 1 000 | 930 | 0,05 |
| Carrington Mortgage Loan Trust | | | | Harvest CLO DAC | | | | Pony S.A. Compartment German Auto Loans | | | |
| 6,460 % éch. 25/06/2035 | 385 | 377 | 0,02 | 4,566 % éch. 26/06/2030 | € 265 | 289 | 0,01 | 4,502 % éch. 14/11/2032 | € 8 600 | 9 528 | 0,49 |
| Cars Alliance Auto Leases France | | | | 4,695 % éch. 15/10/2030 | 2 999 | 3 281 | 0,17 | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust | | | |
| 4,503 % éch. 21/10/2038 | € 7 200 | 7 978 | 0,41 | 4,725 % éch. 15/07/2031 | 900 | 980 | 0,05 | 6,340 % éch. 25/02/2036 | \$ 1 700 | 1 556 | 0,08 |
| Cedar Funding CLO Ltd. | | | | Hayfin Emerald CLO DAC | | | | RAAC Trust | | | |
| 6,677 % éch. 20/01/2031 | \$ 943 | 942 | 0,05 | 0,000 % éch. 25/01/2037 (b) | 1 000 | 1 105 | 0,06 | 6,970 % éch. 25/09/2047 | 3 105 | 2 976 | 0,15 |
| Chase Funding Trust | | | | Hill FL BV | | | | Red & Black Auto Germany | | | |
| 6,210 % éch. 25/10/2032 | 2 | 2 | 0,00 | 4,544 % éch. 18/05/2030 | 6 192 | 6 861 | 0,35 | 4,283 % éch. 15/09/2032 | € 8 749 | 9 683 | 0,49 |
| CIFC Funding Ltd. | | | | 4,604 % éch. 18/05/2031 | 12 500 | 13 854 | 0,71 | Red & Black Auto Italy SRL | | | |
| 6,640 % éch. 24/04/2031 | 988 | 988 | 0,05 | Home Equity Asset Trust | | | | 4,865 % éch. 28/07/2034 | 1 694 | 1 879 | 0,10 |
| 6,710 % éch. 24/04/2030 | 957 | 955 | 0,05 | 4,787 % éch. 25/10/2035 | \$ 2 900 | 2 793 | 0,14 | Red & Black Auto Lease France | | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | 6,175 % éch. 25/01/2036 | 956 | 895 | 0,05 | 4,556 % éch. 27/06/2035 | 2 600 | 2 877 | 0,15 |
| 7,120 % éch. 25/07/2037 | 198 | 193 | 0,01 | HSI Asset Securitization Corp. Trust | | | | Residential Asset Mortgage Products Trust | | | |
| Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC | | | | 6,250 % éch. 25/01/2036 | 1 200 | 991 | 0,05 | 6,010 % éch. 25/02/2036 | \$ 1 177 | 1 123 | 0,06 |
| 4,623 % éch. 15/12/2032 | € 1 884 | 2 090 | 0,11 | JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. | | | | 6,535 % éch. 25/05/2035 | 2 000 | 1 889 | 0,10 |
| 4,653 % éch. 15/12/2029 | 718 | 794 | 0,04 | 6,400 % éch. 25/12/2035 | 1 339 | 1 293 | 0,07 | Residential Asset Securities Corp. Trust | | | |
| Compartment VCL | | | | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust | | | | 5,750 % éch. 25/07/2036 | 1 200 | 1 148 | 0,06 |
| 4,273 % éch. 21/04/2029 | 718 | 793 | 0,04 | 5,730 % éch. 25/06/2037 | 77 | 77 | 0,00 | Retail Automotive CP Germany UG | | | |
| 4,273 % éch. 21/08/2029 | 2 422 | 2 678 | 0,14 | 5,750 % éch. 25/03/2047 | 610 | 564 | 0,03 | 4,553 % éch. 21/07/2034 | € 5 298 | 5 863 | 0,30 |
| 4,283 % éch. 21/01/2029 | 2 072 | 2 291 | 0,12 | 5,905 % éch. 25/05/2036 | 493 | 463 | 0,02 | Revocar UG | | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates | | | | Jubilee CLO DAC | | | | 4,473 % éch. 21/09/2036 | 5 799 | 6 423 | 0,33 |
| 5,870 % éch. 25/08/2034 | \$ 112 | 107 | 0,01 | 4,565 % éch. 15/04/2030 | € 367 | 402 | 0,02 | 4,513 % éch. 21/04/2036 | 932 | 1 033 | 0,05 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | | | | 4,575 % éch. 15/04/2030 | 945 | 1 037 | 0,05 | Saxon Asset Securities Trust | | | |
| 4,626 % éch. 25/01/2037 | 89 | 88 | 0,00 | 4,615 % éch. 15/04/2031 | 1 200 | 1 304 | 0,07 | 6,370 % éch. 26/12/2034 | \$ 210 | 200 | 0,01 |
| 5,610 % éch. 25/08/2037 | 86 | 86 | 0,00 | KKR CLO Ltd. | | | | SC Germany S.A. Compartment Consumer | | | |
| 5,750 % éch. 25/02/2037 | 889 | 834 | 0,04 | 6,655 % éch. 15/04/2031 | \$ 951 | 950 | 0,05 | 4,578 % éch. 15/09/2037 | € 8 100 | 8 985 | 0,46 |
| 5,750 % éch. 25/03/2037 | 953 | 912 | 0,05 | Koromo Italy SRL | | | | SCF Rahoituspalvelut DAC | | | |
| 6,010 % éch. 25/03/2036 | 543 | 474 | 0,02 | 4,676 % éch. 26/02/2035 | € 840 | 930 | 0,05 | 4,435 % éch. 25/06/2032 | 1 135 | 1 255 | 0,06 |
| 6,475 % éch. 25/10/2035 | 108 | 106 | 0,01 | Laurelin DAC | | | | 4,535 % éch. 25/06/2033 | 6 000 | 6 650 | 0,34 |
| 6,565 % éch. 25/07/2035 | 51 | 51 | 0,00 | 4,713 % éch. 20/10/2031 | 1 045 | 1 143 | 0,06 | Silver Arrow Athlon NL BV | | | |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | LCM LP | | | | 4,576 % éch. 26/04/2031 | 8 753 | 9 683 | 0,49 |
| 5,077 % éch. 25/01/2032 | 2 | 2 | 0,00 | 6,785 % éch. 15/10/2031 | \$ 7 015 | 7 008 | 0,36 | Silver Arrow S.A. | | | |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC | | | | Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | 4,273 % éch. 15/02/2030 | 5 647 | 6 243 | 0,32 |
| 7,045 % éch. 25/03/2046 | 1 500 | 1 429 | 0,07 | 5,910 % éch. 25/02/2036 | 918 | 891 | 0,05 | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust | | | |
| Cumulus Static CLO DAC | | | | 6,030 % éch. 25/10/2034 | 5 | 4 | 0,00 | 5,590 % éch. 25/03/2037 | \$ 4 626 | 2 514 | 0,13 |
| 5,499 % éch. 25/04/2033 | € 1 000 | 1 104 | 0,06 | 6,070 % éch. 25/01/2036 | 336 | 314 | 0,02 | 5,970 % éch. 25/06/2037 | 5 803 | 3 362 | 0,17 |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC | | | | LT Autorahoitus DAC | | | | 6,445 % éch. 25/12/2035 | 95 | 93 | 0,00 |
| 4,555 % éch. 15/09/2031 | 896 | 975 | 0,05 | 4,534 % éch. 18/07/2033 | € 11 810 | 13 087 | 0,67 | Steele Creek CLO Ltd. | | | |
| Driver UK Multi-Compartment S.A. | | | | 4,744 % éch. 18/12/2032 | 9 040 | 10 036 | 0,51 | 6,744 % éch. 21/04/2031 | 971 | 972 | 0,05 |
| 5,847 % éch. 25/04/2031 | £ 9 400 | 12 004 | 0,61 | Madison Park Funding Ltd. | | | | Structured Asset Investment Loan Trust | | | |
| Dryden Euro CLO DAC | | | | 6,405 % éch. 15/04/2029 | \$ 2 047 | 2 039 | 0,10 | 5,650 % éch. 25/09/2036 | 6 581 | 4 070 | 0,21 |
| 4,862 % éch. 15/05/2034 | € 998 | 1 086 | 0,06 | Man GLG Euro CLO DAC | | | | 6,090 % éch. 25/01/2036 | 1 180 | 1 086 | 0,06 |
| E-Carat PLC | | | | 4,615 % éch. 15/12/2031 | € 923 | 1 008 | 0,05 | 6,235 % éch. 25/08/2035 | 1 433 | 1 375 | 0,07 |
| 5,567 % éch. 18/08/2029 | £ 514 | 656 | 0,03 | 4,645 % éch. 15/10/2030 | 357 | 392 | 0,02 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| Ellington Loan Acquisition Trust | | | | 4,835 % éch. 15/01/2030 | 262 | 290 | 0,01 | 5,740 % éch. 25/03/2036 | 1 405 | 1 300 | 0,07 |
| 6,520 % éch. 25/05/2037 | \$ 1 714 | 1 666 | 0,08 | 5,779 % éch. 15/10/2036 | 600 | 664 | 0,03 | 5,780 % éch. 25/08/2046 | 3 164 | 2 758 | 0,14 |
| EquiFirst Mortgage Loan Trust | | | | MidOcean Credit CLO | | | | 5,790 % éch. 25/10/2036 | 1 560 | 1 085 | 0,06 |
| 7,195 % éch. 25/12/2034 | 449 | 426 | 0,02 | 6,794 % éch. 21/04/2031 | \$ 12 444 | 12 444 | 0,63 | 5,890 % éch. 25/02/2037 | 1 145 | 1 104 | 0,06 |
| FACT Master S.A. | | | | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | | | | Toro European CLO DAC | | | |
| 4,539 % éch. 20/07/2028 | € 1 286 | 1 425 | 0,07 | 5,600 % éch. 25/10/2036 | 702 | 611 | 0,03 | 4,812 % éch. 15/02/2034 | € 5 100 | 5 557 | 0,28 |
| FCT CA Leasing | | | | 5,970 % éch. 25/04/2036 | 1 658 | 1 555 | 0,08 | Trinitas CLO Ltd. | | | |
| 4,736 % éch. 26/02/2042 | 1 151 | 1 276 | 0,07 | 6,325 % éch. 25/03/2034 | 908 | 906 | 0,05 | 6,777 % éch. 20/07/2031 | \$ 1 535 | 1 536 | 0,08 |
| First Franklin Mortgage Loan Trust | | | | 6,385 % éch. 25/07/2034 | 901 | 907 | 0,05 | Venture CLO Ltd. | | | |
| 5,950 % éch. 25/05/2036 | \$ 6 681 | 5 609 | 0,29 | 6,385 % éch. 25/09/2034 | 1 460 | 1 436 | 0,07 | 6,535 % éch. 15/04/2027 | 2 628 | 2 628 | 0,13 |
| Fremont Home Loan Trust | | | | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust | | | | 6,915 % éch. 15/01/2032 | 1 000 | 998 | 0,05 |
| 5,810 % éch. 25/02/2037 | 3 862 | 1 297 | 0,07 | 5,790 % éch. 25/04/2036 | 194 | 139 | 0,01 | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust | | | |
| FTA Santander Consumo | | | | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | 5,780 % éch. 25/08/2036 | 819 | 776 | 0,04 |
| 4,773 % éch. 21/03/2036 | € 864 | 956 | 0,05 | 5,650 % éch. 25/12/2036 | 1 834 | 650 | 0,03 | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | | | |
| GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust | | | | 5,965 % éch. 25/05/2036 | 258 | 257 | 0,01 |
| 6,110 % éch. 25/12/2035 | \$ 3 139 | 2 989 | 0,15 | 6,100 % éch. 25/02/2036 | 1 417 | 1 272 | 0,06 | | | | 428 392 21,83 |
| Ginkgo Personal Loans | | | | Northwoods Capital Ltd. | | | | | | | |
| 4,666 % éch. 23/09/2044 | € 1 500 | 1 662 | 0,08 | 7,246 % éch. 15/06/2031 | 976 | 978 | 0,05 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | |
| Ginkgo Sales Finance | | | | Octagon Investment Partners Ltd. | | | | Korea Housing Finance Corp. | | | |
| 4,576 % éch. 25/11/2049 | 2 872 | 3 183 | 0,16 | 6,867 % éch. 20/01/2031 | 2 246 | 2 249 | 0,11 | 0,010 % éch. 05/02/2025 | € 5 000 | 5 308 | 0,27 |
| Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. | | | | Option One Mortgage Loan Trust | | | | 0,010 % éch. 07/07/2025 | 5 000 | 5 249 | 0,27 |
| 6,656 % éch. 15/09/2037 | \$ 356 | 356 | 0,02 | 5,690 % éch. 25/04/2037 | 1 963 | 1 372 | 0,07 | 0,723 % éch. 22/03/2025 | 1 260 | 1 344 | 0,07 |
| Griffith Park CLO DAC | | | | Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates | | | | | | | 11 901 0,61 |
| 4,704 % éch. 21/11/2031 | € 5 975 | 6 496 | 0,33 | 6,205 % éch. 25/11/2035 | 274 | 223 | 0,01 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| GSA Home Equity Trust | | | | OZLME DAC | | | | BILLETTS DE TRÉSORERIE | | | |
| 5,970 % éch. 25/01/2036 | \$ 969 | 331 | 0,02 | 5,288 % éch. 27/07/2032 | € 1 440 | 1 553 | 0,08 | Bank of Nova Scotia | | | |
| GSAMP Trust | | | | Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | 5,272 % éch. 01/02/2024 | CAD 7 400 | 5 584 | 0,28 |
| 5,610 % éch. 25/12/2036 | 994 | 523 | 0,03 | 0,000 % éch. 15/05/2033 | 1 000 | 1 102 | 0,06 | 5,298 % éch. 16/01/2024 | 3 400 | 2 572 | 0,13 |
| | | | | 5,602 % éch. 15/11/2032 | 579 | 640 | 0,03 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR L'ACTIF (en milliers) | EN % DE NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR L'ACTIF (en milliers) | EN % DE NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR L'ACTIF (en milliers) | EN % DE NET |
|------------------------------------|-------------------------------|------------------------------------|-------------|-------------------------------------|-------------------------------|------------------------------------|--------------|--|------------|------------------------------------|-------------|
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 2 000 | \$ 1 516 | 0,08 | (0,231) % éch. | 837 000 | 5 938 | 0,30 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| 5,229 % éch. 02/01/2024 CAD | | | | 26/02/2024 (c)(d) | | | | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 5,271 % éch. 07/02/2024 | 2 700 | 2 036 | 0,10 | (0,206) % éch. | 1 666 000 | 11 820 | 0,60 | PIMCO Select Funds | | | |
| Royal Bank of Canada | | | | 13/02/2024 (c)(d) | | | | plc - Fonds PIMCO | | | |
| 5,342 % éch. 01/02/2024 | 3 043 | 2 296 | 0,12 | (0,202) % éch. | 3 654 000 | 25 923 | 1,32 | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | 17 975 383 | \$ 179 118 | 9,12 |
| | | 14 004 | 0,71 | 13/02/2024 (c)(d) | | 86 905 | 4,43 | | | | |
| BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | | Total des Instruments à court terme | | 100 909 | 5,14 | Total des Fonds d'investissement | | \$ 179 118 | 9,12 |
| (0,280) % éch. | | | | Total des Valeurs mobilières | | \$ 1 318 561 | 67,18 | | | | |
| 09/01/2024 (c)(d) | ¥ 2 913 000 | 20 663 | 1,06 | | | | | | | | |
| (0,269) % éch. | | | | | | | | | | | |
| 09/01/2024 (c)(d) | 33 000 | 234 | 0,01 | | | | | | | | |
| (0,260) % éch. | | | | | | | | | | | |
| 09/01/2024 (c)(d) | 34 000 | 241 | 0,01 | | | | | | | | |
| (0,252) % éch. | | | | | | | | | | | |
| 26/02/2024 (c)(d) | ¥ 3 113 000 | \$ 22 086 | 1,13 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|---------------------|--|--|---------------------|
| BOS | 5,420 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 130 000 | Billets du Trésor américain 3,625 % échéance 31/03/2030 | \$ (132 961) | \$ 130 000 | \$ 130 078 | 6,62 |
| BPS | 5,460 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 80 000 | Ginnie Mae 5,500 % échéance 20/10/2052 | (82 373) | 80 000 | 80 049 | 4,08 |
| | 5,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 19 700 | Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 15/02/2032 | (20 093) | 19 700 | 19 712 | 1,00 |
| BRC | 5,420 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 38 800 | Freddie Mac 7,000 % échéance 01/01/2054 | (40 217) | 38 800 | 38 806 | 1,98 |
| DEU | 5,480 | 02/01/2024 | 03/01/2024 | 11 000 | Obligations du Trésor américain 2,750 % échéance 15/08/2042 | (11 260) | 11 000 | 11 002 | 0,56 |
| FICC | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 1 388 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | (1 416) | 1 388 | 1 388 | 0,07 |
| GSC | 5,450 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 50 000 | Ginnie Mae 4,500 % échéance 20/07/2052 | (52 981) | 50 000 | 50 030 | 2,55 |
| SAL | 5,390 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 25 000 | Billets du Trésor américain 0,750 % échéance 31/03/2026 | (25 551) | 25 000 | 25 015 | 1,27 |
| | 5,450 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 130 000 | Billets du Trésor américain 0,875 % échéance 30/09/2026 | (132 893) | 130 000 | 130 079 | 6,62 |
| TDM | 5,450 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 58 700 | Obligations du Trésor américain 2,375 % échéance 15/02/2042 | (60 377) | 58 700 | 58 736 | 2,99 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (560 122) | \$ 544 588 | \$ 544 895 | 27,74 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars | Long | 03/2024 | 2 287 | \$ 19 145 | 0,97 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 73 | (334) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 505 | (80) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 131 | 307 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 238 | (845) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 11 | (128) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Court | 03/2024 | 6 | (53) | 0,00 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 18 012 | 0,92 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 2 500 | \$ (19) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 1 100 | (6) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 700 | 11 | 0,00 |
| Exelon Generation Co. LLC | 1,000 | 20/12/2024 | 800 | (2) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 1 700 | 15 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 3 700 | 31 | 0,00 |
| Total | | | | \$ 30 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2028 | \$ 198 700 | \$ 1 575 | 0,08 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 % | 15/06/2024 | \$ 237 900 | \$ 893 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2027 | 22 900 | (128) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 28 900 | 374 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,875 | 07/02/2050 | 300 | 140 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/01/2050 | 900 | 433 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 20/03/2050 | 1 900 | 904 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 3 200 | 209 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2030 | 7 100 | 183 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 7 200 | 37 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 12 300 | 176 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 37 700 | (270) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 70 400 | (788) | (0,04) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 50 900 | (401) | (0,02) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | € 23 800 | (420) | (0,02) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,418 | 11/07/2052 | \$ 5 700 | 81 | 0,00 |
| | | | | | \$ 1 423 | 0,07 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 3 028 | 0,15 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽³⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/ à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------|-----------------------------------|----------------------------|---|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| CBK | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 677 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 6 992 | 10/01/2024 | \$ 0 | \$ (29) | \$ (29) | 0,00 |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 4 143 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 42 788 | 17/01/2024 | 0 | (185) | (185) | (0,01) |
| FAR | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 3 736 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 38 585 | 05/06/2024 | 0 | (164) | (164) | (0,01) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 21 307 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 220 055 | 26/06/2024 | 0 | (940) | (940) | (0,05) |
| JPM | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 9 621 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 99 364 | 06/03/2024 | 0 | (416) | (416) | (0,02) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 5 404 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 55 812 | 20/03/2024 | 0 | (233) | (233) | (0,01) |
| RBC | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 14 061 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 145 220 | 10/04/2024 | 0 | (623) | (623) | (0,03) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 340 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 3 511 | 17/01/2024 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 5 593 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 57 764 | 24/01/2024 | 0 | (243) | (243) | (0,01) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 13 035 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 134 623 | 21/02/2024 | 0 | (561) | (561) | (0,03) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 24 072 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 248 612 | 15/05/2024 | 0 | (1 041) | (1 041) | (0,05) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 12 647 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 130 616 | 17/07/2024 | 0 | (563) | (563) | (0,03) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 1 157 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 11 949 | 24/07/2024 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 1 365 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 14 097 | 07/08/2024 | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 5 226 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 53 973 | 16/10/2024 | 0 | (231) | (231) | (0,01) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 1 366 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 14 108 | 06/11/2024 | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 10 727 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 110 787 | 13/11/2024 | 0 | (474) | (474) | (0,02) |

| Contrepartie | À payer/ à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------|--|----------------------|--------------------|---------------------------|---|-----------------|------------------------|
| TOR | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 167 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 1 725 | 21/02/2024 | \$ 0 | \$ (8) | \$ (8) | 0,00 |
| UAG | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 1 532 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 15 822 | 21/08/2024 | 0 | (69) | (69) | (0,01) |
| | | | | | | | \$ 0 | \$ (5 969) | \$ (5 969) | (0,30) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|---|------------------------|
| BOA | 01/2024 | £ | \$ 4 780 | \$ 0 | \$ (18) | \$ (18) | 0,00 |
| | 02/2024 | CAD | \$ 1 964 | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | DKK | 2 659 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 744 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 18 198 | 0 | (92) | (92) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 4 156 | 16 | (15) | 1 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | € | \$ 390 644 | 0 | (1 820) | (1 820) | (0,10) |
| | 01/2024 | ¥ | 20 284 | 0 | (867) | (867) | (0,04) |
| | 02/2024 | | 26 640 | 0 | (1 607) | (1 607) | (0,08) |
| CBK | 01/2024 | CAD | 2 462 | 0 | (118) | (118) | (0,01) |
| | 01/2024 | NZD | 117 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | \$ | € 1 018 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | DKK | \$ 3 523 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 225 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | CAD | \$ 1 464 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 02/2024 | | 5 419 | 0 | (196) | (196) | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | € | 3 309 | 0 | (51) | (51) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 812 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | € 823 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | ¥ | \$ 35 963 | 0 | (2 004) | (2 004) | (0,10) |
| MYI | 01/2024 | € | 41 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | € 1 261 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | | € 922 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 121 | ZAR 2 302 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 11 | £ 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | CAD | \$ 2 216 | 0 | (92) | (92) | (0,01) |
| UAG | 01/2024 | £ | 98 539 | 0 | (725) | (725) | (0,04) |
| | | | | \$ 58 | \$ (7 791) | \$ (7 733) | (0,40) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|---|------------------------|
| BPS | 01/2024 | € | \$ 250 | \$ 1 | \$ (4) | \$ (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | € 8 286 | 114 | 0 | 114 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | | 62 463 | 320 | 0 | 320 | 0,01 |
| CBK | 01/2024 | € | \$ 1 008 | 1 | (4) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | € 282 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € | \$ 2 117 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | € 69 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | | 70 499 | 407 | 0 | 407 | 0,02 |
| RYL | 01/2024 | | 17 677 | 187 | 0 | 187 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | | 70 499 | 347 | 0 | 347 | 0,02 |
| | | | | \$ 1 383 | \$ (23) | \$ 1 360 | 0,07 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|--------------------------|---|------------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ | £ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | £ | \$ 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | £ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 119 | SGD 159 | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | SGD 8 | \$ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 79 | SGD 105 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 118 | 158 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| IND | 02/2024 | SGD 118 | \$ 89 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 81 | 61 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 75 | SGD 101 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 118 | \$ 89 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 02/2024 | 118 | 89 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 269 | SGD 355 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | SGD 434 | \$ 328 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | \$ 6 | \$ (5) | \$ 1 | 0,00 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ (12 341) | (0,63) |
| Total des Investissements | | | | | | \$ 2 050 966 | 104,48 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | \$ (87 978) | (4,48) |
| Actifs nets | | | | | | \$ 1 962 988 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).
- (b) Titre vendu avant l'émission.
- (c) Titre à coupon zéro.
- (d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (f) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 49 516 \$ (31 décembre 2022 : 45 395 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 7 390 \$ (31 décembre 2022 : 40 550 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 317 011 | \$ 1 550 | \$ 1 318 561 |
| Fonds d'investissement | 179 118 | 0 | 0 | 179 118 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 544 588 | 0 | 544 588 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 18 758 | (10 059) | 0 | 8 699 |
| Totaux | \$ 197 876 | \$ 1 851 540 | \$ 1 550 | \$ 2 050 966 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 711 694 | \$ 0 | \$ 711 694 |
| Fonds d'investissement | 92 742 | 0 | 0 | 92 742 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 156 445 | 0 | 156 445 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (14 139) | (3 519) | 0 | (17 658) |
| Totaux | \$ 78 603 | \$ 864 620 | \$ 0 | \$ 943 223 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O | \$ (653) | \$ 580 | \$ (73) |
| BOA | (100) | 0 | (100) | (428) | 290 | (138) |
| BPS | (5) | 0 | (5) | 4 | 0 | 4 |
| BRC | (3 973) | 5 190 | 1 217 | 9 | 0 | 9 |
| CBK | (332) | (1 910) | (2 242) | 2 647 | (2 506) | 141 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (53) | 0 | (53) |
| DUB | 2 | 0 | 2 | S/O | S/O | S/O |
| FAR | (1 104) | (10 880) | (11 984) | (1 148) | 18 390 | 17 242 |
| GLM | (17) | 0 | (17) | (184) | 0 | (184) |
| IND | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (1 521) | (12 380) | (13 901) | 753 | (700) | 53 |
| MBC | (2 072) | 2 200 | 128 | (1 953) | 3 760 | 1 807 |
| MYI | 441 | (890) | (449) | (224) | 0 | (224) |
| RBC | (3 302) | (33 130) | (36 432) | (1 063) | 16 910 | 15 847 |
| RYL | 187 | (300) | (113) | S/O | S/O | S/O |
| SCX | 4 | 0 | 4 | 2 420 | (2 270) | 150 |
| SSB | (93) | 0 | (93) | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (8) | 0 | (8) | S/O | S/O | S/O |
| UAG | (447) | (370) | (817) | 2 | 620 | 622 |
| UBS | S/O | S/O | S/O | (35) | 0 | (35) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 41,60 | 33,61 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 25,43 | 35,70 |
| Autres valeurs mobilières | 0,15 | 1,24 |
| Fonds d'investissement | 9,12 | 9,19 |
| Contrats de mise en pension | 27,74 | 15,52 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,92 | (1,39) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,15 | (0,37) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,63) | 0,01 |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 12,17 | 6,99 |
| Agences du gouvernement américain | 6,81 | 0,59 |
| Obligations du Trésor américain | 5,87 | S/O |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 14,75 | 25,04 |
| Titres adossés à des actifs | 21,83 | 22,85 |
| Émissions souveraines | 0,61 | S/O |
| Instruments à court terme | 5,14 | 15,08 |
| Fonds d'investissement | 9,12 | 9,19 |
| Contrats de mise en pension | 27,74 | 15,52 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,92 | (1,39) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,10) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | S/O | (0,30) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,08 | 0,00 |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,07 | 0,03 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,30) | (0,24) |
| Contrats de change à terme | (0,40) | (0,30) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,07 | 0,55 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (4,48) | 6,49 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|---|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|--|------------------------------|-------|-------|------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | VALEURS MOBILIÈRES | | | | VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | BANQUE ET FINANCE | | | | BANQUE ET FINANCE | | | | | | |
| Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027 | \$ | 43 | 38 | 0,34 | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,877 % éch. 25/11/2034 | \$ | 9 | 8 | 0,07 | Pretium Mortgage Credit Partners LLC 2,240 % éch. 27/09/2060 | \$ | 92 | 92 | 0,82 |
| Bank of America N.A. 5,650 % éch. 18/08/2025 | | 100 | 101 | 0,91 | CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,504 % éch. 15/06/2057 | | 100 | 97 | 0,87 | | | 1 685 | 15,08 | |
| Goldman Sachs Group, Inc. 7,273 % éch. 15/03/2028 | | 100 | 101 | 0,90 | Dutch Property Finance BV 5,202 % éch. 28/04/2050 | € | 26 | 29 | 0,26 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % éch. 09/03/2028 | | 50 | 44 | 0,39 | Frost CMBS DAC 5,152 % éch. 20/11/2033 | | 99 | 105 | 0,94 | Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 (c) MXN 160 8 0,07 | | | | |
| Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053 | DKK | 690 | 83 | 0,74 | GSR Mortgage Loan Trust 4,511 % éch. 25/11/2035 | \$ | 15 | 13 | 0,12 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | |
| Wells Fargo & Co. 1,338 % éch. 04/05/2025 | € | 100 | 110 | 0,99 | Mortgage Equity Conversion Asset Trust 5,290 % éch. 25/02/2042 | | 56 | 54 | 0,48 | BILLETS DE TRÉSORERIE | | | | |
| | | | 477 | 4,27 | Precise Mortgage Funding PLC 6,420 % éch. 12/12/2055 | £ | 39 | 49 | 0,44 | Bank of Nova Scotia 5,272 % éch. 01/02/2024 CAD 100 76 0,68 | | | | |
| | | | | | Shamrock Residential DAC 4,726 % éch. 24/01/2061 | € | 76 | 83 | 0,74 | Royal Bank of Canada 5,250 % éch. 09/02/2024 100 75 0,67 | | | | |
| | | | | | Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,970 % éch. 19/07/2035 | \$ | 19 | 18 | 0,16 | 151 1,35 | | | | |
| | | | | | 6,090 % éch. 25/09/2045 | | 11 | 9 | 0,08 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | |
| | | | | | Structured Asset Securities Corp. 5,750 % éch. 25/01/2036 | | 39 | 34 | 0,30 | 10,900 % éch. 04/01/2024 (a)(b) HUF 7 000 20 0,18 | | | | |
| | | | | | 5,820 % éch. 25/03/2035 | | | 702 | 6,28 | BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | | |
| | | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | (0,305) % éch. | | | | | |
| | | | | | Ares European CLO DAC 4,625 % éch. 15/10/2030 | € | 95 | 104 | 0,93 | 09/01/2024 (a)(b) ¥ 10 000 71 0,63 | | | | |
| | | | | | Armada Euro CLO DAC 4,685 % éch. 15/07/2031 | | 99 | 109 | 0,98 | (0,260) % éch. | | | | |
| | | | | | Avoca CLO DAC 4,655 % éch. 15/07/2030 | | 49 | 54 | 0,48 | 09/01/2024 (a)(b) 10 000 71 0,63 | | | | |
| | | | | | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,790 % éch. 25/08/2036 | \$ | 74 | 70 | 0,63 | (0,245) % éch. | | | | |
| | | | | | 6,720 % éch. 25/08/2037 | | 10 | 10 | 0,09 | 04/03/2024 (a)(b) 10 000 71 0,64 | | | | |
| | | | | | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 4,925 % éch. 16/01/2033 | € | 100 | 109 | 0,98 | (0,217) % éch. | | | | |
| | | | | | Contego CLO DAC 4,642 % éch. 23/01/2030 | | 100 | 108 | 0,97 | 19/02/2024 (a)(b) 15 000 106 0,95 | | | | |
| | | | | | Fremont Home Loan Trust 6,085 % éch. 25/11/2035 | \$ | 100 | 88 | 0,79 | (0,213) % éch. | | | | |
| | | | | | Griffith Park CLO DAC 4,704 % éch. 21/11/2031 | € | 100 | 108 | 0,97 | 19/02/2024 (a)(b) 15 000 106 0,95 | | | | |
| | | | | | GSAA Home Equity Trust 7,345 % éch. 25/02/2035 | \$ | 100 | 98 | 0,88 | (0,207) % éch. | | | | |
| | | | | | GSAMP Trust 5,610 % éch. 25/12/2036 | | 139 | 73 | 0,65 | 05/02/2024 (a)(b) 30 000 213 1,91 | | | | |
| | | | | | Home Equity Loan Trust 5,700 % éch. 25/04/2037 | | 65 | 62 | 0,55 | (0,202) % éch. | | | | |
| | | | | | HSI Asset Securitization Corp. Trust 6,250 % éch. 25/01/2036 | | 100 | 83 | 0,74 | 13/02/2024 (a)(b) 30 000 213 1,91 | | | | |
| | | | | | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,680 % éch. 25/10/2036 | | 18 | 18 | 0,16 | 851 7,62 | | | | |
| | | | | | Jubilee CLO DAC 4,575 % éch. 15/04/2030 | € | 94 | 104 | 0,93 | BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | |
| | | | | | Man GLG Euro CLO DAC 4,835 % éch. 15/01/2030 | | 26 | 29 | 0,26 | 5,363 % éch. | | | | |
| | | | | | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 6,325 % éch. 25/03/2034 | \$ | 57 | 57 | 0,51 | 11/01/2024 (a)(b) \$ 1 000 999 8,94 | | | | |
| | | | | | Oak Hill European Credit Partners DAC 4,723 % éch. 20/01/2032 | € | 91 | 100 | 0,89 | 5,373 % éch. | | | | |
| | | | | | Palmer Square European Loan Funding DAC 5,602 % éch. 15/11/2032 | | 97 | 107 | 0,96 | 16/01/2024 (a)(b) 1 000 998 8,93 | | | | |
| | | | | | 5,938 % éch. 12/04/2032 | | 92 | 102 | 0,91 | 5,400 % éch. | | | | |
| | | | | | | | | | | 02/01/2024 (a)(b) 1 000 1 000 8,94 | | | | |
| | | | | | | | | | | 2 997 26,81 | | | | |
| | | | | | | | | | | Total des Instruments à court terme 4 019 35,96 | | | | |
| | | | | | | | | | | Total des Valeurs mobilières \$ 9 254 82,81 | | | | |
| | | | | | | | | | | ACTIONS | | | | |
| | | | | | | | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | | |
| | | | | | | | | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d) 66 550 663 5,93 | | | | |
| | | | | | | | | | | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | | |
| | | | | | | | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d) 3 800 379 3,39 | | | | |
| | | | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement \$ 1 042 9,32 | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| BOS | 5,420 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 900 | Billets du Trésor américain 4,000 % échéance 28/02/2030 | \$ (921) | \$ 900 | \$ 901 | 8,05 |
| SSB | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 195 | Billets du Trésor américain 0,250 % échéance 31/07/2025 | (199) | 195 | 195 | 1,75 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (1 120) | \$ 1 095 | \$ 1 096 | 9,80 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2024 | 22 | \$ (34) | (0,31) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Long | 06/2024 | 22 | 20 | 0,18 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars | Long | 03/2024 | 5 | 43 | 0,38 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 1 | (5) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 11 | 23 | 0,21 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 9 | (20) | (0,18) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 19 | 54 | 0,49 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 1 | 9 | 0,08 |
| | | | | \$ 90 | 0,81 |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 90 0,81**INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS** (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/12/2028 | \$ 198 | \$ 5 | 0,04 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 5 700 | 20 | 0,18 |
| | | | | \$ 25 | 0,22 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|---|------------------------|
| À recevoir ⁽³⁾ | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000 % | 21/03/2034 | ¥ 40 000 | \$ (5) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,407 | 21/07/2024 | \$ 200 | (1) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2028 | 200 | 5 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,740 | 15/02/2027 | 100 | 1 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2025 | 350 | 4 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2027 | 300 | (6) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 17/06/2030 | 100 | (3) | (0,03) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/06/2051 | 100 | (6) | (0,06) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,277 | 21/07/2031 | 200 | (6) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 18/12/2029 | 200 | (6) | (0,05) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2024 | 600 | (10) | (0,09) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 700 | (13) | (0,12) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 18/12/2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 21/06/2053 | 100 | (7) | (0,07) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2030 | 200 | (4) | (0,04) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 900 | (29) | (0,25) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 200 | (3) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 300 | (10) | (0,09) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 200 | (9) | (0,08) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 1 000 | 0 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 900 | 23 | 0,20 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 13/09/2033 | 100 | 4 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 100 | 4 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/12/2025 | 1 900 | 19 | 0,17 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 100 | 5 | 0,04 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | AUD 500 | 19 | 0,17 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 90 | (10) | (0,09) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 100 | (2) | (0,02) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 200 | 10 | 0,09 |
| | | | | | \$ (36) | (0,32) |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

\$ (11) (0,10)

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 % | 22/01/2024 | 100 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 100 | (1) | (2) | (0,02) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (2) | \$ (2) | (0,02) |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/ à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/ (moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---------------------|-----------------------------------|----------------------------|---|-------------------|-----------------|------------------------|-----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 62 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | \$ 640 | 02/10/2024 | \$ 0 | \$ (3) | \$ (3) | (0,02) |
| BRC | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 123 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 1 270 | 02/10/2024 | 0 | (5) | (5) | (0,05) |
| CBK | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 170 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 1 756 | 10/01/2024 | 0 | (7) | (7) | (0,07) |
| RBC | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 569 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 5 877 | 21/02/2024 | 0 | (25) | (25) | (0,22) |
| | À recevoir | Indice S&P 500 Total Return Index | 41 | Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné | 423 | 06/11/2024 | 0 | (2) | (2) | (0,02) |
| | | | | | | | \$ 0 | \$ (42) | \$ (42) | (0,38) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devises à livrer | Devises à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 03/2024 | IDR 223 881 | \$ 14 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 4 | IDR 62 106 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 | INR 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 6 | CAD 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | ¥ 20 000 | \$ 136 | 0 | (6) | (6) | (0,05) |
| | 01/2024 | \$ 13 | AUD 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 65 | ¥ 9 500 | 3 | 0 | 3 | 0,03 |
| | 01/2024 | 5 | PLN 21 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 68 | ZAR 1 304 | 3 | 0 | 3 | 0,03 |
| | 02/2024 | ¥ 30 000 | \$ 202 | 0 | (14) | (14) | (0,11) |
| | 03/2024 | 10 000 | 68 | 0 | (4) | (4) | (0,03) |
| | 06/2024 | KRW 31 791 | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | AUD 24 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 4 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 22 | CAD 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 14 | £ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 139 | MXN 2 442 | 6 | 0 | 6 | 0,04 |
| | 01/2024 | 39 | ZAR 712 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 7 | BRL 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 44 | \$ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 4 | IDR 62 047 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | 7 | KRW 9 019 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 06/2024 | KRW 31 925 | \$ 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD 393 | 289 | 0 | (9) | (9) | (0,08) |
| | 01/2024 | DKK 535 | 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 81 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 12 | AUD 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 62 | BRL 318 | 3 | 0 | 3 | 0,03 |
| | 03/2024 | CNH 1 729 | \$ 238 | 0 | (6) | (6) | (0,06) |
| | 03/2024 | \$ 17 | CNH 121 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 92 | IDR 1 456 820 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| JPM | 01/2024 | BRL 24 | \$ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 3 503 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 533 | 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 | BRL 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 143 | \$ 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | CAD 100 | 73 | 0 | (3) | (3) | (0,02) |
| | 02/2024 | \$ 25 | BRL 124 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | 113 | INR 9 461 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 273 681 | \$ 17 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 03/2024 | INR 584 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 5 537 | 178 | 0 | (5) | (5) | (0,05) |
| | 03/2024 | \$ 5 | IDR 78 257 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 | INR 55 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 12 | TWD 371 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 04/2024 | BRL 44 | \$ 9 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 30 701 | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | CAD 11 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 1 251 | 1 375 | 0 | (7) | (7) | (0,06) |
| | 01/2024 | ¥ 1 100 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 4 | BRL 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | CAD 100 | \$ 72 | 0 | (4) | (4) | (0,03) |
| | 02/2024 | ¥ 60 000 | 406 | 0 | (23) | (23) | (0,20) |
| MYI | 03/2024 | CNH 50 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL 39 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 3 519 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 187 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 06/2024 | KRW 24 886 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | MXN 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 03/2024 | \$ 9 | CNH 63 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 03/2024 | 7 | INR 622 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 47 158 | \$ 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 03/2024 | \$ 6 | TWD 181 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 47 | \$ 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 236 | 13 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | | | | \$ 20 | \$ (84) | \$ (64) | (0,57) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | £ 60 | \$ 76 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 17 | £ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | £ 165 | \$ 209 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 40 | £ 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 224 | \$ 284 | 0 | (1) | (1) | (0,02) |
| MBC | 01/2024 | 165 | 208 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 9 | £ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 114 | \$ 144 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| SCX | 01/2024 | 19 | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 313 | £ 248 | 2 | 0 | 2 | 0,02 |
| SSB | 01/2024 | 251 | 199 | 3 | 0 | 3 | 0,02 |
| UAG | 01/2024 | 313 | 247 | 2 | 0 | 2 | 0,02 |
| | | | | \$ 7 | \$ (6) | \$ 1 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ (107) | (0,96) |
| Total des Investissements | | | | | | \$ 11 363 | 101,68 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | \$ (188) | (1,68) |
| Actifs nets | | | | | | \$ 11 175 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
- (b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
- (c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.
- (d) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 389 \$ (31 décembre 2022 : 221 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 640 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 9 230 | \$ 24 | \$ 9 254 |
| Fonds d'investissement | 663 | 379 | 0 | 1 042 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 095 | 0 | 1 095 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 38 | (66) | 0 | (28) |
| Totaux | \$ 701 | \$ 10 638 | \$ 24 | \$ 11 363 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-----------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 7 750 | \$ 0 | \$ 7 750 |
| Fonds d'investissement | 528 | 376 | 0 | 904 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 1 374 | 0 | 1 374 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 9 | (44) | 0 | (35) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (583) | 0 | (583) |
| Totaux | \$ 537 | \$ 8 873 | \$ 0 | \$ 9 410 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ (5) | \$ 0 | \$ (5) | \$ (43) | \$ 0 | \$ (43) |
| BRC | (23) | (30) | (53) | (4) | 80 | 76 |
| CBK | (2) | 0 | (2) | 7 | 0 | 7 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (1) | 0 | (1) |
| DUB | S/O | S/O | S/O | (47) | 0 | (47) |
| FAR | S/O | S/O | S/O | (16) | 280 | 264 |
| GLM | (8) | 0 | (8) | (1) | 0 | (1) |
| JPM | (9) | 0 | (9) | S/O | S/O | S/O |
| MBC | (36) | 0 | (36) | (19) | 0 | (19) |
| MYC | (2) | 0 | (2) | S/O | S/O | S/O |
| MYI | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| RBC | (27) | (260) | (287) | (17) | 280 | 263 |
| RYL | S/O | S/O | S/O | (26) | 0 | (26) |
| SCX | 2 | 0 | 2 | 3 | 0 | 3 |
| SSB | 3 | 0 | 3 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 46,60 | 20,10 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 36,21 | 61,13 |
| Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire | S/O | 0,10 |
| Fonds d'investissement | 9,32 | 9,49 |
| Contrats de mise en pension | 9,80 | 14,42 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,81 | (0,07) |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,10) | 1,43 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,96) | (1,72) |
| Titres vendus à découvert | S/O | (6,12) |

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 4,71 | 8,52 |
| Agences du gouvernement américain | 14,54 | 7,38 |
| Obligations du Trésor américain | 6,17 | 1,25 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 6,28 | 9,36 |
| Titres adossés à des actifs | 15,08 | 20,52 |
| Émissions souveraines | 0,07 | S/O |
| Instruments à court terme | 35,96 | 34,30 |
| Fonds d'investissement | 9,32 | 9,49 |
| Contrats de mise en pension | 9,80 | 14,42 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,81 | (0,07) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,22 | 0,46 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,32) | 0,97 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | S/O |
| Swaps de rendement total sur indices | (0,38) | (0,39) |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Contrats de change à terme | (0,57) | (1,42) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,01 | 0,09 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (6,12) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (1,68) | 1,24 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|--|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---------|-------|--|--|
| 6,000 % éch. 01/01/2054 | \$ 31 925 | \$ 32 419 | 7,20 | Eurosail PLC | € 2 477 | \$ 3 117 | 0,69 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust | \$ 5 101 | \$ 4 491 | 1,00 | | | | |
| 6,500 % éch. 01/02/2054 | 12 625 | 12 937 | 2,88 | 6,039 % éch. 13/09/2045 | 880 | 1 117 | 0,25 | 5,720 % éch. 25/11/2047 | 1 891 | 1 718 | 0,38 | | | | |
| 7,000 % éch. 01/03/2054 | 3 300 | 3 398 | 0,76 | 6,289 % éch. 13/06/2045 | | | | 6,535 % éch. 25/08/2035 | 973 | 971 | 0,22 | | | | |
| | | 198 742 | 44,18 | Greenpoint Mortgage Funding Trust | \$ 370 | 334 | 0,07 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust | 167 | 52 | 0,01 | | | | |
| OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | Grifonas Finance PLC | € 177 | 191 | 0,04 | Cumulus Static CLO DAC | € 1 400 | 1 546 | 0,34 | | | | |
| Obligations du Trésor américain | | | | GSMPS Mortgage Loan Trust | \$ 1 238 | 1 106 | 0,25 | Fieldstone Mortgage Investment Trust | \$ 1 748 | 1 013 | 0,23 | | | | |
| 2,875 % éch. 15/11/2046 | 2 200 | 1 762 | 0,39 | 7,060 % éch. 20/10/2032 | | | | First Franklin Mortgage Loan Trust | 4 076 | 3 865 | 0,86 | | | | |
| 3,000 % éch. 15/11/2045 | 4 800 | 3 951 | 0,88 | GSMSC Resecuritization Trust | 7 355 | 1 939 | 0,43 | Fremont Home Loan Trust | 1 431 | 650 | 0,14 | | | | |
| 3,000 % éch. 15/08/2048 | 20 | 16 | 0,00 | 2,167 % éch. 26/04/2037 | | | | Golden Bar Securitisation SRL | € 1 500 | 1 679 | 0,37 | | | | |
| 3,000 % éch. 15/02/2049 | 3 500 | 2 849 | 0,63 | HomeBanc Mortgage Trust | 3 815 | 13 | 0,00 | GSAMP Trust | \$ 9 000 | 6 882 | 1,53 | | | | |
| 3,125 % éch. 15/02/2043 | 114 | 98 | 0,02 | 3,815 % éch. 25/04/2037 | | | | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust | 1 745 | 1 202 | 0,27 | | | | |
| 3,375 % éch. 15/05/2044 | 20 | 18 | 0,00 | JPMorgan Mortgage Trust | 4 473 | 24 | 0,01 | 5,630 % éch. 25/11/2036 | 3 219 | 2 816 | 0,63 | | | | |
| 3,625 % éch. 15/08/2043 | 372 | 342 | 0,08 | 4,473 % éch. 25/08/2036 | 30 | 24 | 0,01 | 5,640 % éch. 25/04/2037 | 1 807 | 1 245 | 0,28 | | | | |
| 3,625 % éch. 15/02/2044 | 280 | 257 | 0,06 | 5,099 % éch. 25/01/2037 | 76 | 65 | 0,01 | HSI Asset Securitization Corp. Trust | 5 610 | 4 795 | 0,81 | | | | |
| 3,750 % éch. 15/11/2043 | 160 | 150 | 0,03 | Legacy Mortgage Asset Trust | 7 221 | 680 | 0,15 | Long Beach Mortgage Loan Trust | 5 830 | 2 964 | 0,53 | | | | |
| 4,375 % éch. 15/08/2043 (j) | 1 000 | 1 021 | 0,23 | 7,221 % éch. 28/01/2070 | 679 | 680 | 0,15 | 6,070 % éch. 25/01/2036 | 2 589 | 2 252 | 0,50 | | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (f) | | | | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust | 6 570 | 3 203 | 0,71 | Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust | 8 720 | 165 | 0,04 | | | | |
| 0,125 % éch. 15/07/2024 (i) | 5 209 | 5 120 | 1,14 | 6,570 % éch. 25/09/2037 | 7 300 | 3 203 | 0,71 | Madison Park Euro Funding DAC | € 1 500 | 1 633 | 0,36 | | | | |
| 0,125 % éch. 15/10/2024 (i) | 4 629 | 4 528 | 1,01 | Morgan Stanley Capital Trust | 7 609 | 2 961 | 0,66 | 4,715 % éch. 15/01/2032 | € 1 500 | 1 633 | 0,36 | | | | |
| 0,125 % éch. 15/04/2025 | 447 | 431 | 0,10 | 7,609 % éch. 15/07/2035 | 3 026 | 2 961 | 0,66 | Man GLG Euro CLO DAC | 5 779 | 3 189 | 0,71 | | | | |
| 0,125 % éch. 15/01/2031 | 118 | 106 | 0,02 | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | 5 730 | 49 | 0,01 | MASTR Asset-Backed Securities Trust | 5 990 | 1 234 | 0,27 | | | | |
| 0,125 % éch. 15/07/2031 | 115 | 102 | 0,02 | 5,730 % éch. 25/04/2035 | 49 | 46 | 0,01 | 5,990 % éch. 25/06/2036 | \$ 1 400 | 1 234 | 0,27 | | | | |
| 0,250 % éch. 15/01/2025 | 1 721 | 1 671 | 0,37 | Mortimer BTL PLC | 0 000 | 1 534 | 0,34 | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust | 3 938 | 911 | 0,18 | | | | |
| 0,250 % éch. 15/02/2050 | 1 197 | 781 | 0,17 | 0,000 % éch. 22/12/2056 | € 1 200 | 1 534 | 0,34 | 5,580 % éch. 25/02/2037 | 699 | 331 | 0,07 | | | | |
| 0,500 % éch. 15/04/2024 (i) | 3 477 | 3 433 | 0,76 | Primrose Residential DAC | 4 876 | 2 267 | 0,50 | 5,620 % éch. 25/02/2037 | 2 169 | 1 028 | 0,23 | | | | |
| 0,625 % éch. 15/01/2024 | 5 907 | 5 892 | 1,31 | 4,876 % éch. 24/10/2061 | € 2 064 | 2 267 | 0,50 | 5,720 % éch. 25/03/2037 | 7 988 | 3 424 | 0,76 | | | | |
| 0,625 % éch. 15/07/2032 | 3 177 | 2 904 | 0,65 | RBSGC Mortgage Loan Trust | 6 000 | 14 | 0,00 | Nassau Ltd. | 6 905 | 1 311 | 0,29 | | | | |
| 0,750 % éch. 15/02/2042 | 136 | 111 | 0,03 | 6,000 % éch. 25/01/2037 | \$ 14 | 12 | 0,00 | Nelnet Student Loan Trust | 5 910 | 2 621 | 0,58 | | | | |
| 0,750 % éch. 15/02/2045 | 1 045 | 818 | 0,18 | RMAC PLC | 0 000 | 1 663 | 0,37 | 5,910 % éch. 27/09/2066 | 2 621 | 2 612 | 0,58 | | | | |
| 0,875 % éch. 15/02/2047 | 1 275 | 1 006 | 0,22 | 0,000 % éch. 15/02/2047 | € 1 300 | 1 663 | 0,37 | New Century Home Equity Loan Trust | 6 250 | 72 | 0,02 | | | | |
| 1,000 % éch. 15/02/2046 | 519 | 425 | 0,10 | Sandwell Commercial Finance PLC | 5 875 | 21 | 0,00 | 6,250 % éch. 25/03/2035 | 18 | 22 | 0,00 | | | | |
| 1,000 % éch. 15/02/2048 | 1 622 | 1 310 | 0,29 | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | 4 213 | 50 | 0,01 | 7,495 % éch. 25/05/2034 | | | | | | | |
| 1,000 % éch. 15/02/2049 | 3 925 | 3 163 | 0,70 | 4,213 % éch. 25/09/2035 | \$ 50 | 31 | 0,01 | Palmer Square European Loan Funding DAC | 0 000 | 1 400 | 0,34 | | | | |
| 1,375 % éch. 15/07/2033 | 4 052 | 3 932 | 0,87 | 6,412 % éch. 25/05/2035 | 117 | 82 | 0,02 | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | 6 790 | 5 365 | 1,11 | | | | |
| 1,375 % éch. 15/02/2044 | 132 | 118 | 0,03 | Twin Bridges PLC | 6 432 | 1 200 | 1 533 | 0,34 | Penta CLO DAC | 4 906 | 1 634 | 0,36 | | | |
| 1,500 % éch. 15/02/2053 | 828 | 752 | 0,17 | 6,432 % éch. 15/05/2056 | € 1 200 | 1 533 | 0,34 | Renaissance Home Equity Loan Trust | 5 434 | 17 | 0,00 | | | | |
| 2,125 % éch. 15/02/2041 | 140 | 144 | 0,03 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | 4 397 | 1 881 | 0,34 | Saxon Asset Securities Trust | 7 220 | 1 574 | 0,33 | | | | |
| Billets du Trésor américain | | | | 6,060 % éch. 25/08/2046 | 819 | 662 | 0,15 | SLM Student Loan Trust | 6 252 | 3 012 | 0,66 | | | | |
| 0,375 % éch. 30/09/2027 | 110 | 96 | 0,02 | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | 5 500 | 269 | 0,05 | Sound Point Euro CLO Funding DAC | 5 065 | € 1 500 | 1 641 | 0,36 | | | |
| 0,500 % éch. 31/10/2027 | 200 | 176 | 0,04 | 5,500 % éch. 25/05/2035 | 269 | 216 | 0,05 | Soundview Home Loan Trust | 5 935 | 7 565 | 6 302 | 1,40 | | | |
| 0,625 % éch. 30/11/2027 | 1 860 | 1 640 | 0,36 | Wells Fargo Alternative Loan Trust | 6 250 | 845 | 0,16 | 6,470 % éch. 25/09/2037 | 5 597 | 3 892 | 0,86 | | | | |
| 0,625 % éch. 31/12/2027 | 760 | 668 | 0,15 | 6,376 % éch. 25/10/2036 | 11 | 9 | 0,00 | 6,505 % éch. 25/05/2035 | 1 012 | 1 000 | 0,22 | | | | |
| 0,750 % éch. 31/01/2028 | 640 | 564 | 0,13 | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | 5 810 | 90 | 88 | 0,02 | | | |
| 1,250 % éch. 30/06/2028 (i) | 14 000 | 12 487 | 2,78 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | 5 950 | 6 351 | 1,27 | 5,970 % éch. 25/11/2037 | 2 600 | 2 284 | 0,51 | | | | |
| 1,500 % éch. 15/08/2026 | 200 | 187 | 0,04 | Aegis Asset-Backed Securities Trust | 6 470 | 476 | 0,10 | 6,595 % éch. 25/07/2035 | 1 220 | 1 201 | 0,27 | | | | |
| 2,250 % éch. 15/11/2025 | 1 030 | 992 | 0,22 | 6,470 % éch. 25/03/2035 | 476 | 445 | 0,10 | TruPS Financials Note Securitization Ltd. | 7 202 | 1 366 | 1 335 | 0,30 | | | |
| 2,375 % éch. 31/03/2029 | 3 200 | 2 972 | 0,66 | Ameriquest Mortgage Securities Trust | 5 980 | 212 | 0,05 | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust | 5 890 | 6 | 6 | 0,00 | | | |
| 2,625 % éch. 31/01/2026 (i) | 9 200 | 8 912 | 1,98 | 5,980 % éch. 25/04/2036 | 212 | 211 | 0,05 | | | | | 100 577 | 22,35 | | |
| 2,625 % éch. 15/02/2029 | 160 | 151 | 0,03 | Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | 6 445 | 3 990 | 3 669 | 0,82 | | | | | | | |
| 2,750 % éch. 15/02/2028 | 600 | 574 | 0,13 | 6,445 % éch. 25/09/2035 | 1 635 | 1 306 | 0,29 | | | | | | | | |
| 2,875 % éch. 15/08/2028 | 120 | 115 | 0,03 | Arbour CLO DAC | 4 905 | € 1 400 | 1 526 | 0,34 | | | | | | | |
| 2,875 % éch. 30/04/2029 (i) | 8 700 | 8 277 | 1,84 | 4,905 % éch. 15/03/2033 | € 1 400 | 1 526 | 0,34 | | | | | | | | |
| 2,875 % éch. 15/05/2032 | 630 | 584 | 0,13 | Argent Securities Trust | 5 770 | € 4 909 | 4 278 | 0,95 | | | | | | | |
| 4,000 % éch. 31/10/2029 | 3 600 | 3 618 | 0,80 | Asset-Backed Funding Certificates Trust | 6 295 | 0 | 0,00 | | | | | | | | |
| | | 89 224 | 19,83 | 6,295 % éch. 25/08/2033 | 0 | 0 | 0,00 | | | | | | | | |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust | 7 420 | 257 | 0,06 | | | | | | | | |
| American Home Mortgage Assets Trust | 5 932 | 4 405 | 1 241 | 0,28 | Castlelake Aircraft Securitization Trust | 4 125 | 503 | 459 | 0,10 | | | | | | |
| Avon Finance PLC | € 3 100 | 3 943 | 0,88 | Centerline Logistics Corp. | 9 250 | 38 | 38 | 0,01 | | | | | | | |
| Banc of America Funding Corp. | \$ 1 629 | 1 489 | 0,33 | 9,250 % éch. 15/12/2027 | 47 | 47 | 0,01 | | | | | | | | |
| Banc of America Funding Trust | 3 452 | 28 | 0,01 | 9,750 % éch. 15/12/2027 | | | | | | | | | | | |
| Bear Stearns Mortgage Funding Trust | 5 910 | 778 | 0,17 | | | | | | | | | | | | |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust | 6 000 | 178 | 0,03 | | | | | | | | | | | | |
| Countrywide Alternative Loan Trust | 5 500 | 1 883 | 1 370 | 0,30 | | | | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 25/09/2035 | 1 601 | 1 419 | 0,32 | | | | | | | | | | | | |
| 5,750 % éch. 25/06/2037 | 308 | 219 | 0,05 | | | | | | | | | | | | |
| 6,000 % éch. 25/10/2035 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | 6 130 | 574 | 455 | 0,10 | | | | | | | | | | | |
| 6,130 % éch. 25/02/2035 | | | | | | | | | | | | | | | |
| Countrywide Home Loan Repperforming REMIC Trust | 6 500 | 179 | 166 | 0,04 | | | | | | | | | | | |
| 6,500 % éch. 25/11/2034 | | | | | | | | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|---------|-------------------------------|---------------------|---|---------|-------------------------------|---------------------|---|---------|-------------------------------|---------------------|
| BAE Systems PLC | 94 192 | \$ 1 333 | 0,30 | Nucor Corp. | 4 372 | \$ 761 | 0,17 | Crown Castle, Inc. | 8 106 | \$ 934 | 0,21 |
| Caterpillar, Inc. (c) | 793 | 234 | 0,05 | Steel Dynamics, Inc. | 3 789 | 447 | 0,10 | Digital Realty Trust, Inc. | 10 808 | 1 455 | 0,32 |
| Cie de Saint-Gobain S.A. | 14 208 | 1 048 | 0,23 | Vale S.A. | 60 900 | 965 | 0,21 | EPR Properties | 21 702 | 1 051 | 0,23 |
| Deutsche Post AG | 6 133 | 304 | 0,07 | | | 7 800 | 1,73 | Equity Residential | 11 005 | 673 | 0,15 |
| Eiffage S.A. | 2 260 | 243 | 0,05 | IMMOBILIER | | | | Gaming and Leisure Properties, Inc. | 30 410 | 1 501 | 0,33 |
| GEA Group AG | 4 932 | 205 | 0,05 | Sunac Services Holdings Ltd. | 61 391 | 15 | 0,00 | Healthcare Realty Trust, Inc. | 44 352 | 764 | 0,17 |
| ITOCHU Corp. (c) | 4 300 | 175 | 0,04 | | | | | Healthpeak Properties, Inc. | 31 892 | 631 | 0,14 |
| Mitsubishi Corp. (c) | 50 400 | 803 | 0,18 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | Highwoods Properties, Inc. | 57 621 | 1 323 | 0,29 |
| Mitsui & Co. Ltd. (c) | 13 500 | 506 | 0,11 | E.ON SE | 13 061 | 176 | 0,04 | Kilroy Realty Corp. | 24 160 | 963 | 0,21 |
| Mitsui OSK Lines Ltd. (c) | 10 800 | 345 | 0,08 | Endesa S.A. | 9 980 | 204 | 0,05 | Macerich Co. | 34 342 | 530 | 0,12 |
| Nippon Yusen KK (c) | 15 000 | 463 | 0,10 | Enel SpA (c) | 145 393 | 1 082 | 0,24 | National Storage Affiliates Trust | 26 906 | 1 116 | 0,25 |
| Owens Corning (c) | 2 797 | 415 | 0,09 | Engie S.A. | 46 731 | 824 | 0,18 | Omega Healthcare Investors, Inc. | 17 116 | 525 | 0,12 |
| PACCAR, Inc. (c) | 6 539 | 639 | 0,14 | Fortum Oyj | 13 857 | 200 | 0,05 | Park Hotels & Resorts, Inc. | 101 507 | 1 553 | 0,35 |
| Siemens AG (c) | 1 069 | 201 | 0,05 | Iberdrola S.A. (c) | 13 543 | 178 | 0,04 | Public Storage | 1 985 | 605 | 0,14 |
| SKF AB « B » | 9 354 | 188 | 0,04 | Power Grid Corp. of India Ltd. | 145 791 | 415 | 0,09 | Realty Income Corp. | 15 458 | 888 | 0,20 |
| Thales S.A. | 2 192 | 325 | 0,07 | | | 3 079 | 0,69 | Simon Property Group, Inc. | 11 424 | 1 629 | 0,36 |
| Vinci S.A. | 7 520 | 947 | 0,21 | | | 110 865 | 24,64 | Uniti Group, Inc. | 1 773 | 10 | 0,00 |
| | | 10 672 | 2,37 | BONS DE SOUSCRIPTION | | | | VICI Properties, Inc. | 111 492 | 3 555 | 0,79 |
| TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION | | | | Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060 | 706 | 0 | 0,00 | WP Carey, Inc. | 13 160 | 853 | 0,19 |
| Apple, Inc. | 8 634 | 1 662 | 0,37 | Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17/02/2027 | 1 128 | 3 | 0,00 | | | 24 636 | 5,48 |
| ASE Technology Holding Co. Ltd. | 94 000 | 412 | 0,09 | | | 3 | 0,00 | | | | |
| Asustek Computer, Inc. | 13 000 | 207 | 0,05 | TITRES PRIVILÉGIÉS | | | | | | | |
| Cisco Systems, Inc. (c) | 58 371 | 2 949 | 0,66 | Bayerische Motoren Werke AG 0,000 % | 1 772 | 177 | 0,04 | INSTRUMENTS A COURT TERME | | | |
| HCL Technologies Ltd. (c) | 26 787 | 471 | 0,10 | Gerdau S.A. 0,000 % | 34 600 | 167 | 0,04 | BONS DU TRÉSOR ARGENTIN | | | |
| KLA Corp. | 328 | 191 | 0,04 | Nationwide Building Society 10,250 % | 6 220 | 1 033 | 0,23 | (34,368) % éch. | | | |
| Lite-On Technology Corp. | 61 000 | 232 | 0,05 | Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 % | 149 900 | 1 144 | 0,25 | 20/05/2024 (d)(e) ARS | 30 963 | 49 | 0,01 |
| MediaTek, Inc. (c) | 47 000 | 1 552 | 0,34 | Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. 0,000 % | 2 983 | 180 | 0,04 | (32,600) % éch. | | | |
| Microsoft Corp. (c) | 2 948 | 1 108 | 0,25 | Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 % | 93 | 0 | 0,00 | 14/10/2024 (d)(e) | 26 599 | 94 | 0,02 |
| NetApp, Inc. (c) | 6 482 | 571 | 0,13 | | | 2 701 | 0,60 | | | 143 | 0,03 |
| Novatek Microelectronics Corp. | 18 000 | 303 | 0,07 | SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER | | | | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | |
| NXP Semiconductors NV | 739 | 170 | 0,04 | Apartment Income REIT Corp. | 31 255 | 1 085 | 0,24 | 10,900 % éch. | | | |
| Pegatron Corp. | 59 000 | 168 | 0,04 | Apple Hospitality REIT, Inc. | 64 437 | 1 070 | 0,24 | 04/01/2024 (d)(e) HUF | 176 000 | 508 | 0,12 |
| Quanta Computer, Inc. | 25 000 | 182 | 0,04 | Boston Properties, Inc. | 12 143 | 852 | 0,19 | Total des Instruments à court terme | | 651 | 0,15 |
| Realtek Semiconductor Corp. | 15 000 | 230 | 0,05 | CareTrust REIT, Inc. | 23 360 | 523 | 0,12 | Total des Valeurs mobilières | | \$ 654 744 | 145,53 |
| United Microelectronics Corp. | 353 000 | 601 | 0,13 | CBL & Associates Properties, Inc. | 378 | 9 | 0,00 | | | | |
| | | 11 009 | 2,45 | Cousins Properties, Inc. | 22 100 | 538 | 0,12 | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| MATÉRIAUX | | | | | | | | PIMCO Select Funds | | | |
| BHP Group Ltd. | 38 442 | 1 315 | 0,29 | | | | | plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g) | 17 961 | 179 | 0,04 |
| CRH PLC | 15 380 | 1 064 | 0,24 | | | | | Total des Fonds d'investissement | | \$ 179 | 0,04 |
| Evraz PLC (c) | 72 869 | 0 | 0,00 | | | | | | | | |
| Fortescue Ltd. | 52 634 | 1 039 | 0,23 | | | | | | | | |
| Grupo Mexico S.A.B. de C.V. « B » | 98 100 | 546 | 0,12 | | | | | | | | |
| Heidelberg Materials AG | 4 387 | 392 | 0,09 | | | | | | | | |
| Holcim AG | 16 190 | 1 271 | 0,28 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 605 | Billets du Trésor américain échéance 30/11/2025 | \$ (617) | \$ 605 | \$ 605 | 0,13 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (617) | \$ 605 | \$ 605 | 0,13 |

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|------------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 23 | \$ (88) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2025 | 7 | 26 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Court | 03/2026 | 8 | 18 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2024 | 10 | 53 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Court | 09/2025 | 9 | 23 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2024 | 13 | 79 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2025 | 7 | 22 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2026 | 9 | 20 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2024 | 10 | 45 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2025 | 6 | 14 | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 103 | (242) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 43 | (197) | (0,04) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 12 | 29 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 343 | 1 366 | 0,30 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 11 | 56 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Court | 03/2024 | 154 | (1 503) | (0,33) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 126 | (1 427) | (0,32) |
| | | | | \$ (1 706) | (0,38) |
| | | | | \$ (1 706) | (0,38) |

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ (1 706) (0,38)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|---|------------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2028 | \$ 1 700 | \$ 35 | 0,01 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | 700 | 2 | 0,00 |
| | | | | \$ 37 | 0,01 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|---|------------------------|
| Indice CDX.EM-31 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 946 | \$ 38 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-32 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2024 | 510 | 25 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-34 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2025 | 2 208 | 41 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-36 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2026 | 4 784 | 176 | 0,04 |
| Indice CDX.EM-38 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2027 | 600 | 42 | 0,01 |
| Indice CDX.EM-39 Index à 5 ans | 1,000 | 20/06/2028 | 300 | 15 | 0,00 |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 3 000 | 63 | 0,01 |
| Indice CDX.HY-36 Index à 5 ans | 5,000 | 20/06/2026 | 1 843 | (49) | (0,01) |
| Indice CDX.HY-37 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2026 | 873 | 15 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | 4 257 | 230 | 0,05 |
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 600 | 4 | 0,00 |
| | | | | \$ 600 | 0,13 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/(moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-------------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 % | 20/10/2033 | £ 100 | \$ 11 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 6 000 | (614) | (0,14) |
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 9 690 | 6 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,000 | 15/03/2029 | ¥ 2 430 000 | 452 | 0,10 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,020 | 20/09/2028 | 2 950 000 | 464 | 0,10 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,176 | 27/04/2027 | 160 000 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,400 | 15/06/2032 | 248 400 | 41 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 15/03/2042 | 121 000 | 70 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,711 | 27/04/2042 | 37 000 | 23 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2026 | \$ 32 900 | 2 243 | 0,50 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,500 | 16/06/2028 | 26 200 | (2 169) | (0,48) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 15/12/2024 | 53 300 | (2 420) | (0,54) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 16/06/2031 | 13 442 | (1 372) | (0,30) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 16/06/2031 | 16 200 | 1 785 | 0,40 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 0,940 | 08/06/2026 | 2 000 | 156 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2027 | 1 200 | 85 | 0,02 |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 % | 15/06/2027 | \$ 15 700 | \$ (1 467) | (0,33) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/06/2029 | 2 770 | (320) | (0,07) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2030 | 1 766 | 292 | 0,06 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,235 | 12/05/2028 | 700 | 79 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/12/2026 | 34 300 | 3 318 | 0,74 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 17/06/2027 | 12 000 | (1 541) | (0,34) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/12/2028 | 3 900 | (429) | (0,10) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 17/06/2030 | 47 620 | 4 824 | 1,07 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 15/06/2032 | 5 950 | (673) | (0,15) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/06/2051 | 4 300 | (1 035) | (0,23) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,350 | 20/01/2027 | 3 400 | 279 | 0,06 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,360 | 20/07/2031 | 800 | 132 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,370 | 19/07/2031 | 500 | 82 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,380 | 04/01/2027 | 1 400 | (112) | (0,03) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,405 | 07/09/2031 | 1 300 | 209 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,425 | 18/01/2027 | 1 000 | (77) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,443 | 18/01/2027 | 1 100 | (84) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450 | 17/02/2027 | 2 400 | 184 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,450 | 16/07/2031 | 1 200 | 193 | 0,04 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,491 | 21/01/2051 | 900 | (330) | (0,07) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 15/12/2028 | 7 130 | (898) | (0,20) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 12/01/2029 | 578 | 64 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 05/10/2031 | 600 | (93) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,535 | 15/10/2031 | 600 | (91) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,535 | 22/10/2031 | 400 | (60) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,545 | 26/10/2031 | 400 | (60) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,550 | 20/01/2027 | 15 100 | (1 087) | (0,24) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,570 | 11/01/2027 | 800 | (59) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,580 | 16/02/2027 | 900 | (63) | (0,02) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,590 | 09/02/2051 | 7 200 | (2 521) | (0,56) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,600 | 16/01/2026 | 6 600 | 221 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,625 | 16/01/2050 | 3 100 | 1 088 | 0,24 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,625 | 03/02/2050 | 3 900 | 1 368 | 0,30 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 06/03/2024 | 2 300 | (11) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 17/02/2027 | 9 600 | (622) | (0,14) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,700 | 12/01/2029 | 2 100 | (204) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,740 | 16/12/2026 | 1 100 | 79 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2027 | 26 000 | 743 | 0,16 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2029 | 1 209 | 55 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 1 878 | 110 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 15/06/2032 | 1 840 | (183) | (0,04) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 22/01/2050 | 7 600 | 2 528 | 0,56 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,768 | 02/02/2032 | 300 | (41) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,785 | 12/08/2051 | 700 | 237 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,817 | 05/04/2032 | 2 200 | (305) | (0,07) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,872 | 06/04/2032 | 1 100 | (148) | (0,03) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,875 | 07/02/2050 | 400 | 123 | 0,03 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,895 | 18/10/2049 | 700 | 231 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,910 | 17/10/2049 | 700 | 228 | 0,05 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,928 | 25/03/2027 | 1 100 | (86) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2027 | 1 250 | (15) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2029 | 5 740 | (52) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 18/02/2032 | 900 | (103) | (0,02) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 21/12/2032 | 9 130 | (31) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/01/2050 | 1 400 | 407 | 0,09 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 15/12/2051 | 6 500 | (2 357) | (0,53) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250 | 11/12/2049 | 7 100 | 1 731 | 0,38 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,250 | 12/03/2050 | 3 400 | 809 | 0,18 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,300 | 17/01/2026 | 4 600 | 150 | 0,03 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,350 | 17/01/2025 | 7 900 | 178 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,450 | 20/12/2024 | 15 900 | 371 | 0,08 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 18/12/2024 | 6 000 | 486 | 0,11 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 20/12/2024 | 10 900 | 17 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,841 | 31/10/2024 | 600 | (9) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,850 | 30/08/2027 | 1 000 | (31) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,910 | 14/11/2024 | 600 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,920 | 17/10/2024 | 1 700 | (26) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,955 | 04/10/2027 | 1 000 | (23) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,973 | 27/10/2024 | 600 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,993 | 13/10/2024 | 600 | (8) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 19/06/2024 | 41 600 | 1 920 | 0,43 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 19/06/2026 | 32 300 | 1 926 | 0,43 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2030 | 2 090 | 23 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 2 800 | 104 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 21/06/2033 | 160 | (5) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,018 | 24/10/2024 | 500 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 07/09/2027 | 500 | (11) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 08/09/2029 | 500 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 06/09/2032 | 700 | (21) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,080 | 23/02/2053 | 200 | (11) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,088 | 07/11/2024 | 600 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,100 | 09/09/2029 | 500 | (11) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notional | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------------|-----------|-----------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,140 % | 25/10/2024 | \$ 500 | \$ (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,190 | 25/10/2024 | 500 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,225 | 25/10/2024 | 500 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 690 | 5 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 21/06/2028 | 590 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 06/03/2033 | 300 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 14/06/2033 | 1 000 | (20) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,340 | 23/02/2030 | 600 | (13) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,350 | 14/12/2032 | 200 | 3 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 01/03/2033 | 400 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 12/07/2053 | 200 | 1 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400 | 23/02/2033 | 200 | (3) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,405 | 01/03/2033 | 300 | (5) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,425 | 01/03/2033 | 300 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430 | 27/02/2033 | 300 | (4) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450 | 07/03/2033 | 600 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 600 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/06/2030 | 900 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2030 | 1 190 | (61) | (0,01) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 22/05/2033 | 29 660 | (24) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 21/06/2033 | 600 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 860 | 25 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 200 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,610 | 12/12/2032 | 400 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 22/11/2024 | 1 100 | (10) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 1 100 | (10) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 10/07/2033 | 400 | 4 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 100 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,700 | 06/06/2033 | 16 970 | (16) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,730 | 03/08/2033 | 200 | 4 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,735 | 07/08/2033 | 200 | 4 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/11/2024 | 1 100 | (9) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 11/12/2024 | 1 100 | (9) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 13/12/2027 | 900 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/12/2028 | 1 080 | (48) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 20/06/2029 | 13 800 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 12/07/2033 | 400 | 7 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 100 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,760 | 23/08/2033 | 500 | 11 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 10/03/2028 | 600 | (1) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 05/09/2028 | 800 | 10 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 100 | 2 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 30/08/2033 | 200 | 5 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 100 | (2) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,830 | 12/10/2053 | 100 | 10 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 100 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 200 | (6) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,870 | 17/10/2053 | 100 | 11 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,880 | 16/10/2053 | 100 | 11 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 30/08/2033 | 600 | 20 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 13/09/2033 | 600 | 23 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 200 | (7) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 04/10/2033 | 500 | 23 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 200 | (8) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,040 | 20/06/2024 | 2 000 | (15) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,060 | 20/06/2024 | 8 100 | (61) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,140 | 22/06/2024 | 3 400 | (23) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,150 | 12/10/2033 | 200 | 11 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,155 | 02/10/2033 | 400 | 23 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,165 | 27/09/2033 | 600 | 35 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,170 | 03/10/2033 | 400 | 23 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,175 | 10/10/2033 | 200 | 12 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,200 | 18/10/2033 | 200 | 12 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,220 | 20/10/2033 | 200 | 13 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,230 | 23/10/2033 | 100 | 6 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2029 | 620 | (3) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2031 | 730 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 22/11/2033 | 200 | (12) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,255 | 23/10/2033 | 100 | 7 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,393 | 25/10/2033 | 100 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,435 | 01/11/2033 | 100 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 31/10/2033 | 100 | 8 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,450 | 01/11/2033 | 300 | 25 | 0,01 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 22/05/2025 | 65 460 | (135) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,900 | 06/06/2025 | 37 050 | 78 | 0,02 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,100 | 22/05/2024 | 126 930 | (135) | (0,03) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,400 | 06/06/2024 | 71 750 | 77 | 0,02 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,874 | 02/01/2026 | BRL 1 200 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,899 | 02/01/2026 | 600 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,939 | 02/01/2026 | 1 100 | (1) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 9,998 | 04/01/2027 | 1 900 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,037 | 04/01/2027 | 500 | 0 | 0,00 |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,041 % | 04/01/2027 | BRL 1 500 | \$ 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,052 | 02/01/2026 | 1 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,085 | 02/01/2026 | 1 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,090 | 04/01/2027 | 2 800 | 1 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,105 | 02/01/2026 | 1 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,138 | 04/01/2027 | 700 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,157 | 02/01/2025 | 1 300 | (5) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,177 | 02/01/2025 | 800 | (3) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,250 | 04/01/2027 | 1 500 | 3 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,275 | 04/01/2027 | 700 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,290 | 04/01/2027 | 800 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,367 | 02/01/2025 | 1 000 | (3) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,731 | 04/01/2027 | 400 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,746 | 04/01/2027 | 1 700 | 9 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,901 | 04/01/2027 | 4 000 | 25 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,018 | 02/01/2025 | 2 800 | 0 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,098 | 02/01/2025 | 4 700 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,158 | 02/01/2025 | 2 300 | 1 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,163 | 02/01/2025 | 2 300 | 1 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,178 | 02/01/2025 | 4 700 | 3 | 0,00 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | CAD 5 300 | 80 | 0,02 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,360 | 07/08/2028 | ZAR 500 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,380 | 04/08/2028 | 400 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,400 | 07/08/2028 | 500 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 31/07/2028 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 04/08/2028 | 1 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,410 | 07/08/2028 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,415 | 31/07/2028 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,415 | 04/08/2028 | 400 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,420 | 31/07/2028 | 300 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,421 | 04/08/2028 | 500 | 1 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,426 | 01/08/2028 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,428 | 31/07/2028 | 200 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,460 | 01/08/2028 | 200 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,460 | 02/08/2028 | 200 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,464 | 02/08/2028 | 200 | 0 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,543 | 04/08/2028 | 500 | 1 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,550 | 03/08/2028 | 800 | 1 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 2,750 | 17/06/2026 | AUD 460 | (13) | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 3,000 | 21/03/2027 | 18 640 | (790) | (0,18) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 3,250 | 17/12/2024 | 1 600 | (69) | (0,02) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 3,500 | 17/06/2025 | 19 492 | (1 105) | (0,25) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,250 | 17/12/2024 | 650 | (56) | (0,01) |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | 300 | 7 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 18/06/2024 | 400 | (42) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,150 | 18/03/2030 | € 6 200 | 987 | 0,22 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,250 | 18/03/2050 | 2 300 | 946 | 0,21 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,329 | 30/12/2025 | 100 | 7 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,363 | 30/06/2025 | 200 | 12 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,395 | 30/12/2024 | 100 | 4 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,425 | 28/06/2024 | 200 | 5 | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,830 | 09/12/2052 | 6 800 | 397 | 0,09 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,000 | 21/09/2032 | 11 880 | (734) | (0,16) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 11/04/2024 | 1 400 | 4 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 13/04/2024 | 2 900 | 8 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,100 | 17/05/2024 | 1 300 | 4 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 26/04/2024 | 1 400 | 8 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 28/04/2024 | 1 300 | 6 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,250 | 03/05/2024 | 1 300 | 6 | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | 800 | 30 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 200 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 300 | (6) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 200 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 100 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 300 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 200 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,970 | 15/12/2033 | 200 | (8) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,990 | 08/12/2033 | 200 | (9) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 3 800 | (239) | (0,05) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 100 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,128 | 04/12/2033 | 100 | (6) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 200 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 100 | (3) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 9 100 | (6) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 06/11/2033 | 200 | (13) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 100 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 08/11/2028 | 300 | (11) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 21/08/2033 | 200 | 15 | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 100 | (7) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,300 | 03/10/2033 | 500 | 39 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 200 | (14) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,370 | 09/10/2028 | 300 | 14 | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,450 % | 20/10/2028 | € 300 | \$ 15 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,160 | 06/06/2025 | MXN 9 300 | (39) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,535 | 04/05/2027 | 18 500 | (110) | (0,03) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,950 | 30/01/2026 | 12 300 | 6 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,980 | 26/08/2024 | 500 | 1 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 5,990 | 30/01/2026 | 15 000 | 6 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,080 | 10/03/2026 | 20 700 | 6 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,490 | 08/09/2026 | 13 700 | (11) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,620 | 18/02/2030 | 600 | (1) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 6,710 | 20/09/2029 | 500 | (1) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,150 | 11/06/2027 | 28 100 | (56) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,165 | 06/09/2032 | 3 000 | (8) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,200 | 11/06/2027 | 2 900 | (6) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,360 | 21/08/2037 | 3 100 | (11) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,370 | 11/10/2027 | 14 800 | (37) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,380 | 04/11/2026 | 400 | (1) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 7,380 | 14/08/2037 | 700 | 1 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,480 | 18/06/2037 | 1 300 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 7,495 | 14/01/2032 | 8 100 | (6) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 7,498 | 15/01/2032 | 33 500 | (27) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,603 | 14/04/2025 | 49 000 | (102) | (0,02) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,610 | 15/04/2025 | 3 000 | (6) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,670 | 05/03/2025 | 52 900 | (103) | (0,02) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,710 | 07/03/2025 | 6 400 | (13) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,715 | 07/03/2025 | 6 300 | (13) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 7,800 | 28/12/2027 | 2 900 | 6 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,818 | 17/02/2027 | 11 400 | (39) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 7,865 | 02/02/2027 | 11 900 | (43) | (0,01) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 7,910 | 30/12/2027 | 600 | 1 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 7,984 | 10/12/2027 | 6 800 | 11 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 7,990 | 21/12/2027 | 100 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,005 | 21/12/2027 | 37 500 | 77 | 0,02 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,010 | 04/02/2027 | 5 200 | (20) | (0,01) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,030 | 31/01/2028 | 4 600 | 7 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,050 | 31/01/2028 | 3 400 | 4 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,090 | 15/01/2027 | 13 000 | (52) | (0,01) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,103 | 04/01/2038 | 5 600 | 6 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,120 | 15/01/2027 | 2 700 | (11) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,300 | 16/06/2028 | 6 800 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,410 | 31/03/2027 | 11 100 | 12 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,444 | 25/07/2028 | 16 200 | (7) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,471 | 26/07/2028 | 8 200 | (3) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,512 | 24/07/2028 | 12 300 | (4) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,550 | 27/07/2028 | 4 100 | (1) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,556 | 27/07/2028 | 24 600 | (5) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,600 | 31/07/2028 | 8 000 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,620 | 28/07/2028 | 4 200 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,636 | 28/07/2028 | 8 300 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,640 | 28/07/2028 | 1 700 | 0 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,650 | 28/07/2028 | 4 200 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,660 | 04/04/2024 | 38 500 | 20 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,660 | 28/07/2028 | 4 200 | 0 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,675 | 03/04/2024 | 92 600 | 48 | 0,01 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,701 | 31/03/2032 | 19 500 | (17) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,730 | 06/04/2027 | 16 500 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,732 | 30/03/2032 | 8 200 | (8) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,750 | 05/04/2024 | 39 700 | 20 | 0,00 |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,000 | 15/09/2031 | £ 300 | (45) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,020 | 15/10/2031 | 400 | (57) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,055 | 15/09/2031 | 400 | (59) | (0,01) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,066 | 15/09/2031 | 600 | (78) | (0,02) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,140 | 15/10/2031 | 1 000 | (128) | (0,03) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,250 | 15/11/2031 | 900 | (90) | (0,02) |
| À payer | IPC Royaume-Uni | 4,400 | 15/10/2031 | 400 | (41) | (0,01) |
| | | | | | \$ 6 420 | 1,43 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ 7 057 | 1,57 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 100 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,690 | 02/04/2024 | 300 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,690 | 02/04/2024 | 300 | (2) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,688 | 02/04/2024 | 600 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,688 | 02/04/2024 | 600 | (5) | (10) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,781 | 05/04/2024 | 1 000 | (8) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,781 | 05/04/2024 | 1 000 | (8) | (15) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,273 | 16/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,723 | 16/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,697 | 02/04/2024 | 1 200 | (9) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,697 | 02/04/2024 | 1 200 | (9) | (19) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 2,721 | 08/04/2024 | 600 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 2,721 | 08/04/2024 | 600 | (5) | (9) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 18/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 100 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 18/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 100 | 0 | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 200 | (1) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| UAG | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (95) | \$ (100) | (0,02) |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | \$ 97,891 | 09/01/2024 | 500 | \$ (2) | \$ (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % éch. 01/02/2054 | 101,094 | 06/02/2024 | 500 | (2) | (4) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % éch. 01/02/2054 | 99,227 | 06/02/2024 | 500 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % éch. 01/02/2054 | 101,227 | 06/02/2024 | 500 | (2) | (4) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | \$ 95,813 | 06/02/2024 | 500 | \$ (3) | \$ (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/02/2054 | 97,813 | 06/02/2024 | 500 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 96,453 | 09/01/2024 | 500 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 98,469 | 09/01/2024 | 500 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 99,906 | 09/01/2024 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ (20) | \$ (22) | 0,00 |

⁽¹⁾ Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 % | 20/12/2024 | \$ 100 | \$ (11) | \$ 11 | \$ 0 | 0,00 |
| BPS | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 200 | (18) | 17 | (1) | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2026 | 300 | (14) | 16 | 2 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 400 | (36) | 38 | 2 | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 940 | (110) | 114 | 4 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2024 | 500 | (9) | 13 | 4 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2024 | 200 | (2) | 3 | 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2024 | 500 | 2 | 2 | 4 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 100 | (4) | 4 | 0 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2024 | 700 | (11) | 14 | 3 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 100 | (10) | 10 | 0 | 0,00 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/12/2024 | 600 | (9) | 13 | 4 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 100 | (4) | 4 | 0 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 100 | (9) | 8 | (1) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 800 | (7) | 14 | 7 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2028 | 300 | (3) | 5 | 2 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/06/2024 | 400 | (36) | 38 | 2 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement turc | 1,000 | 20/12/2024 | 900 | (101) | 105 | 4 | 0,00 |
| HUS | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2024 | 300 | (9) | 10 | 1 | 0,00 |
| JPM | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2026 | 300 | (2) | 7 | 5 | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 200 | (7) | 7 | 0 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 200 | (18) | 17 | (1) | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 600 | (5) | 10 | 5 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2025 | 100 | (1) | 2 | 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2026 | 1 100 | 3 | 15 | 18 | 0,01 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2027 | 400 | (1) | 7 | 6 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2028 | 300 | (6) | 9 | 3 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2028 | 1 300 | (14) | 21 | 7 | 0,01 |
| | | | | | \$ (452) | \$ 534 | \$ 82 | 0,02 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 % | 25/05/2046 | \$ 296 | \$ (70) | \$ 58 | \$ (12) | 0,00 |
| DUB | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 400 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17/01/2047 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| FBF | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11/05/2063 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GST | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 6 850 | 15 | (16) | (1) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18/11/2054 | 7 300 | (38) | 26 | (12) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11/05/2063 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17/10/2057 | 8 682 | (340) | 345 | 5 | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17/09/2058 | 298 | (12) | 12 | 0 | 0,00 |
| MEI | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 500 | (4) | 2 | (2) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17/10/2057 | 200 | (11) | 11 | 0 | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17/09/2058 | 595 | (47) | 48 | 1 | 0,00 |
| MYC | Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25/05/2046 | 469 | (111) | 93 | (18) | (0,01) |
| | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 500 | (4) | 2 | (2) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11/05/2063 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17/10/2057 | 100 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| SAL | Indice CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17/11/2059 | 2 075 | 17 | (17) | 0 | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18/11/2054 | 1 200 | 6 | (8) | (2) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17/08/2061 | 300 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Indice CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17/09/2058 | 15 379 | 15 | (6) | 9 | 0,00 |
| UAG | Indice CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17/10/2057 | 100 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ (602) | \$ 567 | \$ (35) | (0,01) |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD 623 | \$ 412 | \$ 0 | \$ (13) | \$ (13) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 6 769 | 939 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | AUD 623 | 412 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 484 | 615 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 303 | ¥ 487 399 | 157 | 0 | 157 | 0,03 |
| | 02/2024 | 5 | CNY 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 9 527 | \$ 1 315 | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| BPS | 03/2024 | IDR 3 139 050 | 200 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 194 402 | 149 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 1 614 | 1 759 | 0 | (25) | (25) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 1 936 | 2 455 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 22 766 | 65 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 65 689 | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 851 | € 765 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | 100 | IDR 1 546 618 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 3 013 | \$ 163 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD 41 394 | \$ 1 300 | 0 | (68) | (68) | (0,02) |
| BRC | 02/2024 | \$ 6 | CNY 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 6 593 | \$ 916 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 11 774 | 374 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 552 | IDR 8 484 876 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 741 640 | \$ 568 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | 129 230 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 403 | TRY 12 121 | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 99 | ZAR 1 849 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | TRY 26 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 451 | TRY 13 761 | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| CBK | 03/2024 | 50 | IDR 776 911 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 681 | TRY 21 380 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 04/2024 | 865 | 27 868 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 764 439 | \$ 586 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL 56 131 | 11 528 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 2 741 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR 1 542 854 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 23 799 | 1 342 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 227 | € 210 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | 107 | MXN 1 920 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | ZAR 36 392 | \$ 1 914 | 0 | (74) | (74) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 100 | IDR 1 543 250 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2024 | 11 528 | BRL 56 699 | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| | 01/2024 | KRW 64 985 | \$ 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 5 980 | 830 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| GLM | 06/2024 | KRW 826 424 | 635 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 11 291 | 8 311 | 0 | (253) | (253) | (0,06) |
| | 01/2024 | ¥ 46 600 | 318 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 11 149 | BRL 56 163 | 414 | 0 | 414 | 0,09 |
| | 01/2024 | 828 | CAD 1 122 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| | 01/2024 | 1 991 | MXN 34 928 | 62 | 0 | 62 | 0,01 |
| | 01/2024 | 392 | TRY 11 960 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 949 | \$ 50 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 2 948 | 409 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 513 | IDR 7 875 210 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| JPM | 03/2024 | 133 | TRY 4 187 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 118 893 | \$ 339 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 100 | IDR 1 538 700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 50 | KRW 64 807 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TRY 920 | \$ 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD 4 001 | 125 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 737 | BRL 3 612 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 252 | INR 271 694 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 9 577 217 | \$ 618 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 83 963 | 2 701 | 0 | (81) | (81) | (0,02) |
| MBC | 06/2024 | KRW 1 197 643 | 922 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 1 691 | 1 838 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 88 | 111 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 24 087 | 68 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 843 | 44 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 03/2024 | TWD 405 | 13 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 301 | TRY 9 393 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 25 307 | \$ 27 816 | 1 | (147) | (146) | (0,03) |
| | 01/2024 | HUF 7 143 | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 1 218 | 70 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY 50 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 303 | € 273 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 256 | ¥ 185 146 | 58 | 0 | 58 | 0,01 |
| | 01/2024 | 329 | ZAR 6 042 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 02/2024 | 5 | CNY 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2024 | 2 | TRY 52 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | CNH 6 459 | \$ 896 | 0 | (17) | (17) | (0,01) | |
| 03/2024 | IDR 1 964 749 | 128 | 0 | 0 | 0 | 0,00 | |
| 03/2024 | \$ 1 486 | IDR 22 873 309 | 1 | (4) | (3) | 0,00 | |

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| RBC | 06/2024 | KRW 483 813 | \$ 372 | \$ 0 | \$ (5) | \$ (5) | 0,00 |
| SCX | 04/2024 | \$ 3 | MXN 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 8 876 | \$ 468 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 6 341 | 876 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR 1 577 776 | 100 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 8 965 | 284 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 471 | IDR 7 284 202 | 3 | (2) | 1 | 0,00 |
| SOG | 03/2024 | TWD 4 324 | \$ 137 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | \$ 187 | CLP 164 907 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | 2 076 | ¥ 304 474 | 85 | 0 | 85 | 0,02 |
| | 03/2024 | CNH 3 067 | \$ 425 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 780 507 | 49 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 9 836 | 12 447 | 0 | (91) | (91) | (0,02) |
| | 01/2024 | MXN 2 664 | 150 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY 1 815 | 62 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 1 983 | 104 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 62 | TRY 1 872 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | \$ 887 | \$ (1 219) | \$ (332) | (0,07) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution II, T en EUR (couverte) de capitalisation et T en EUR (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD 2 293 | \$ 1 518 | \$ 0 | \$ (46) | \$ (46) | (0,01) |
| BOA | 01/2024 | £ 127 | 161 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 525 415 | 3 560 | 0 | (169) | (169) | (0,04) |
| BPS | 01/2024 | DKK 900 | 133 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 2 688 | 2 939 | 2 | (33) | (31) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 484 | 614 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | INR 55 636 | 667 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 327 307 | 2 232 | 0 | (91) | (91) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 14 713 | € 13 484 | 186 | 0 | 186 | 0,04 |
| BRC | 01/2024 | 1 | CHF 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 102 687 | € 93 370 | 478 | 0 | 478 | 0,11 |
| CBK | 01/2024 | € 1 637 | \$ 1 801 | 2 | (10) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 1 228 103 | 954 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK 677 | 63 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK 28 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 727 | BRL 3 591 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | DKK 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 143 | € 131 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 448 | MXN 7 597 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | NOK 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 212 | \$ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | BRL 3 606 | 727 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 02/2024 | MXN 7 597 | 446 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | SGD 79 | 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| FAR | 01/2024 | BRL 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 0 | BRL 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CHF 6 268 | \$ 7 153 | 0 | (298) | (298) | (0,07) |
| | 01/2024 | CNY 2 902 | 411 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | ILS 687 | 184 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | MYR 1 754 | 377 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 378 | MYR 1 754 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 02/2024 | MYR 1 754 | 378 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | BRL 3 590 | 737 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | SGD 9 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | AUD 1 423 | 944 | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| | 01/2024 | CAD 2 746 | 2 029 | 0 | (54) | (54) | (0,01) |
| | 01/2024 | € 841 | 911 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 7 597 | 442 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 234 | € 213 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | ¥ 199 587 | \$ 1 354 | 0 | (63) | (63) | (0,02) |
| | 01/2024 | SGD 1 241 | 930 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 122 785 | € 111 712 | 645 | 0 | 645 | 0,13 |
| SCX | 01/2024 | CNY 23 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HKD 17 265 | 2 211 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK 9 702 | 934 | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| | 01/2024 | TWD 72 511 | 2 331 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| SOG | 01/2024 | IDR 8 120 471 | 522 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | \$ 1 | KRW 1 054 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | AUD 869 | \$ 577 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK 1 194 | 175 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 2 629 | 3 328 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| | 01/2024 | NOK 3 028 | 284 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 122 879 | € 111 712 | 552 | 0 | 552 | 0,12 |
| | 01/2024 | ZAR 13 337 | \$ 719 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | | | | \$ 1 892 | \$ (1 019) | \$ 873 | 0,18 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | AUD 3 | \$ 2 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 347 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | TWD 5 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | \$ 16 | £ 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 1 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | INR 37 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 401 | 3 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 16 | £ 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| FAR | 01/2024 | CAD 2 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 691 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | SEK 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 | BRL 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 02/2024 | BRL 3 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 0 | BRL 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL 3 | \$ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 01/2024 | SGD 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CHF 4 | 5 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 5 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | SGD 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ILS 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | CNY 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 01/2024 | HKD 12 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 8 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | SEK 6 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | TWD 50 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 89 | £ 71 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR 4 814 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | \$ 53 | £ 42 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 0 | KRW 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | DKK 1 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | NOK 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 90 | £ 71 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 9 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 3 | \$ (2) | \$ 1 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 467 0,10

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Ginnie Mae, TBA 5,500 % éch. 01/01/2054 | \$ 2 000 | \$ (2 015) | (0,45) |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 2,000 % éch. 01/02/2054 | 10 600 | (8 675) | (1,93) |
| 4,500 % éch. 01/03/2054 | 3 300 | (3 200) | (0,71) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (13 890) | (3,09) |
| Total des Investissements | | \$ 647 456 | 143,90 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (197 507) | (43,90) |
| Actifs nets | | \$ 449 949 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(f) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(g) Affilié au Fonds.

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,64 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--|-------------------------|----------|--------------|---------------------|
| AMSURG Corp. | 06/11/2023 | \$ 2 204 | \$ 2 706 | 0,60 |
| Intelsat Emergence S.A. | 19/06/2017 - 23/02/2022 | 5 147 | 1 565 | 0,35 |
| Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032 | 11/02/2020 | 616 | 425 | 0,09 |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC | 25/09/2020 | 278 | 1 295 | 0,29 |
| | | \$ 8 245 | \$ 5 991 | 1,33 |

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 33 030 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

(j) Un titre d'une juste valeur globale de 1 021 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 8 742 \$ (31 décembre 2022 : 10 994 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 164 \$ (31 décembre 2022 : 376 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 77 266 | \$ 570 339 | \$ 7 139 | \$ 654 744 |
| Fonds d'investissement | 179 | 0 | 0 | 179 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 605 | 0 | 605 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (439) | 6 287 | (30) | 5 818 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (13 890) | 0 | (13 890) |
| Totaux | \$ 77 006 | \$ 563 341 | \$ 7 109 | \$ 647 456 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 88 708 | \$ 512 322 | \$ 9 530 | \$ 610 560 |
| Fonds d'investissement | 29 661 | 0 | 0 | 29 661 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 781 | 0 | 781 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 840 | 15 599 | 0 | 16 439 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (13 092) | 0 | (13 092) |
| Totaux | \$ 119 209 | \$ 515 610 | \$ 9 530 | \$ 644 349 |

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| GRE | 5,520 % | 14/12/2023 | 04/01/2024 | \$ (10 161) | \$ (10 189) | (2,27) |
| | 5,520 | 18/12/2023 | 04/01/2024 | (5 891) | (5 903) | (1,31) |
| | 5,520 | 20/12/2023 | 04/01/2024 | (13 081) | (13 105) | (2,91) |
| SCX | 5,750 | 28/12/2023 | 04/01/2024 | (3 926) | (3 928) | (0,87) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (33 125) | (7,36) |

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | En % de l'actif net |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|---|---------------------|
| TDM | 5,530 % | 19/12/2023 | 02/01/2024 | \$ (1 035) | \$ (1 037) | (0,23) |
| Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (1 037) | (0,23) |

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (76) | \$ 0 | \$ (76) | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | (86) | 60 | (26) | (103) | 0 | (103) |
| BOM | S/O | S/O | S/O | (10) | 0 | (10) |
| BPS | (107) | 10 | (97) | 12 | 0 | 12 |
| BRC | 461 | (1 010) | (549) | (125) | 0 | (125) |
| CBK | (100) | 0 | (100) | 3 416 | (3 380) | 36 |
| DUB | (23) | 0 | (23) | (14) | 0 | (14) |
| FAR | (28) | 0 | (28) | (25) | 0 | (25) |
| GLM | (124) | 0 | (124) | (221) | 81 | (140) |
| GST | 9 | 0 | 9 | (156) | 191 | 35 |
| HUS | 1 | 0 | 1 | 17 | 0 | 17 |
| JPM | (106) | 0 | (106) | 67 | 0 | 67 |
| MBC | (141) | 0 | (141) | 2 861 | (2 480) | 381 |
| MEI | (1) | 0 | (1) | (4) | 0 | (4) |
| MYC | 10 | 94 | 104 | (63) | 94 | 31 |
| MYI | 456 | (1 000) | (544) | (71) | (96) | (167) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | 21 | 0 | 21 |
| SAL | (2) | 0 | (2) | (26) | 0 | (26) |
| SCX | (128) | 0 | (128) | 3 628 | (3 470) | 158 |
| SOG | (10) | 0 | (10) | (53) | 0 | (53) |
| SSB | 3 | 0 | 3 | 11 | 0 | 11 |
| TOR | 76 | 0 | 76 | S/O | S/O | S/O |
| UAG | 383 | (990) | (607) | (41) | 10 | (31) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 68,71 | 59,01 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 76,18 | 59,05 |
| Autres valeurs mobilières | 0,64 | 2,47 |
| Fonds d'investissement | 0,04 | 5,86 |
| Contrats de mise en pension | 0,13 | 0,15 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,38) | 0,10 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 1,57 | 1,34 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,10 | 1,80 |
| Titres vendus à découvert | (3,09) | (2,58) |
| Contrats de prise en pension | (7,36) | S/O |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (0,23) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 0,96 | 1,83 |
| Obligations et billets privés | 13,58 | 14,21 |
| Obligations et billets convertibles | 0,00 | S/O |
| Obligations et billets municipaux | 0,07 | 0,08 |
| Agences du gouvernement américain | 44,18 | 31,14 |
| Obligations du Trésor américain | 19,83 | 14,89 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 8,07 | 5,69 |
| Titres adossés à des actifs | 22,35 | 16,75 |
| Émissions souveraines | 5,62 | 4,32 |
| Actions ordinaires | 24,64 | 24,18 |
| Droits | S/O | 0,02 |
| Bons de souscription | 0,00 | 0,01 |
| Titres privilégiés | 0,60 | 0,42 |
| Sociétés d'investissement immobilier | 5,48 | 5,31 |
| Instruments à court terme | 0,15 | 1,68 |
| Fonds d'investissement | 0,04 | 5,86 |
| Contrats de mise en pension | 0,13 | 0,15 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,38) | 0,10 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | 0,00 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,01 | 0,01 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,13 | 0,21 |
| Swaps de taux d'intérêt | 1,43 | 1,12 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (0,09) |
| Options sur titres | 0,00 | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02 | (0,05) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | (0,01) | (0,02) |
| Swaps de rendement total sur indices | S/O | 0,00 |
| Contrats de change à terme | (0,07) | 0,05 |
| Contrats de change à terme couverts | 0,18 | 1,91 |
| Titres vendus à découvert | (3,09) | (2,58) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (43,90) | (27,20) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------|----------------------------|---------------------|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|---------------------------------------|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | CTP NV | | | | KBC Group NV | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETTS PRIVÉS | | | | Danske Bank A/S | | | | LeasePlan Corp. NV | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | Deutsche Bank AG | | | | Lendlease Finance Ltd. | | | |
| AerCap Ireland Capital DAC | | | | Digital Dutch Finco BV | | | | Lloyds Banking Group PLC | | | |
| 2,875 % éch. 14/08/2024 | \$ 4 400 | \$ 4 318 | 0,10 | Digital Euro Finco LLC | | | | Logicor Financing SARL | | | |
| 6,100 % éch. 15/01/2027 | 5 300 | 5 416 | 0,12 | DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Francfort-sur-le-Main | | | | MassMutual Global Funding | | | |
| AIB Group PLC | | | | EQT AB | | | | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | | |
| 2,250 % éch. 04/04/2028 | € 4 400 | 4 665 | 0,11 | Equitable Financial Life Global Funding | | | | NatWest Group PLC | | | |
| 2,875 % éch. 30/05/2031 | 8 800 | 9 332 | 0,21 | Globalworth Real Estate Investments Ltd. | | | | NE Property BV | | | |
| 7,583 % éch. 14/10/2026 | \$ 2 400 | 2 478 | 0,06 | GLP Capital LP | | | | New Immo Holding S.A. | | | |
| Alteara S.C.A. | | | | Goldman Sachs Group, Inc. | | | | Nomura Holdings, Inc. | | | |
| 1,875 % éch. 17/01/2028 | € 8 500 | 7 911 | 0,18 | Goodman HK Finance | | | | Pacific Life Global Funding | | | |
| American Honda Finance Corp. | | | | Goodman U.S. Finance Four LLC | | | | Prologis International Funding S.A. | | | |
| 5,000 % éch. 23/05/2025 | \$ 800 | 803 | 0,02 | GSPA Monetization Trust | | | | Royal Bank of Canada | | | |
| 6,034 % éch. 10/01/2025 | 8 600 | 8 609 | 0,19 | Host Hotels & Resorts LP | | | | Sagax AB | | | |
| 6,094 % éch. 22/11/2024 | 6 300 | 6 311 | 0,14 | HSBC Holdings PLC | | | | Santander UK Group Holdings PLC | | | |
| Assicurazioni Generali SpA | | | | HSBC USA, Inc. | | | | Société Générale S.A. | | | |
| 2,429 % éch. 14/07/2031 | € 1 800 | 1 744 | 0,04 | Indian Railway Finance Corp. Ltd. | | | | Standard Chartered PLC | | | |
| Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc. | | | | ING Groep NV | | | | Starwood Property Trust, Inc. | | | |
| 6,125 % éch. 15/09/2028 | \$ 2 100 | 2 207 | 0,05 | Association internationale de développement | | | | Stifel Financial Corp. | | | |
| Aviation Capital Group LLC | | | | Intesa Sanpaolo SpA | | | | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | |
| 4,125 % éch. 01/08/2025 | 9 080 | 8 820 | 0,20 | Jackson National Life Global Funding | | | | Tesco Property Finance PLC | | | |
| 6,250 % éch. 15/04/2028 | 100 | 102 | 0,00 | JPMorgan Chase & Co. | | | | | | | |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | | | | | | | | | | | |
| 6,750 % éch. 05/09/2027 | € 11 200 | 12 955 | 0,29 | | | | | | | | |
| Banco de Sabadell S.A. | | | | | | | | | | | |
| 0,875 % éch. 16/06/2028 | 6 300 | 6 288 | 0,14 | | | | | | | | |
| Banco Santander S.A. | | | | | | | | | | | |
| 6,527 % éch. 07/11/2027 | \$ 4 000 | 4 139 | 0,09 | | | | | | | | |
| Bank of America Corp. | | | | | | | | | | | |
| 1,197 % éch. 24/10/2026 | 15 000 | 13 939 | 0,32 | | | | | | | | |
| 5,933 % éch. 15/09/2027 | 10 700 | 10 923 | 0,25 | | | | | | | | |
| Bank of Ireland Group PLC | | | | | | | | | | | |
| 0,375 % éch. 10/05/2027 | € 12 300 | 12 642 | 0,29 | | | | | | | | |
| Bank of Montreal | | | | | | | | | | | |
| 5,203 % éch. 01/02/2028 | \$ 5 400 | 5 505 | 0,12 | | | | | | | | |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. | | | | | | | | | | | |
| 5,896 % éch. 13/07/2026 | 3 100 | 3 167 | 0,07 | | | | | | | | |
| Barclays PLC | | | | | | | | | | | |
| 1,700 % éch. 03/11/2026 | £ 5 400 | 6 443 | 0,15 | | | | | | | | |
| 2,852 % éch. 07/05/2026 | \$ 2 400 | 2 315 | 0,05 | | | | | | | | |
| 7,285 % éch. 13/09/2027 | 6 900 | 6 925 | 0,16 | | | | | | | | |
| BGC Group, Inc. | | | | | | | | | | | |
| 8,000 % éch. 25/05/2028 | 4 200 | 4 389 | 0,10 | | | | | | | | |
| BNP Paribas S.A. | | | | | | | | | | | |
| 2,219 % éch. 09/06/2026 | 10 500 | 10 029 | 0,23 | | | | | | | | |
| BPCE S.A. | | | | | | | | | | | |
| 6,612 % éch. 19/10/2027 | 9 500 | 9 784 | 0,22 | | | | | | | | |
| CaixaBank S.A. | | | | | | | | | | | |
| 0,750 % éch. 26/05/2028 | € 2 100 | 2 116 | 0,05 | | | | | | | | |
| 6,684 % éch. 13/09/2027 | \$ 6 900 | 7 078 | 0,16 | | | | | | | | |
| Castellum AB | | | | | | | | | | | |
| 0,750 % éch. 04/09/2026 (h) | € 9 700 | 9 710 | 0,22 | | | | | | | | |
| CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund | | | | | | | | | | | |
| 0,500 % éch. 27/01/2028 | 13 300 | 13 012 | 0,29 | | | | | | | | |
| 0,900 % éch. 12/10/2029 | 7 600 | 6 993 | 0,16 | | | | | | | | |
| Citibank N.A. | | | | | | | | | | | |
| 5,803 % éch. 29/09/2028 | \$ 2 800 | 2 925 | 0,07 | | | | | | | | |
| 5,864 % éch. 29/09/2025 | 3 200 | 3 254 | 0,07 | | | | | | | | |
| Citigroup, Inc. | | | | | | | | | | | |
| 1,250 % éch. 06/07/2026 | € 5 000 | 5 320 | 0,12 | | | | | | | | |
| 3,070 % éch. 24/02/2028 | \$ 7 400 | 6 976 | 0,16 | | | | | | | | |
| Citycon Treasury BV | | | | | | | | | | | |
| 1,625 % éch. 12/03/2028 | € 15 000 | 13 290 | 0,30 | | | | | | | | |
| Clarion Funding PLC | | | | | | | | | | | |
| 1,250 % éch. 13/11/2032 | £ 2 400 | 2 311 | 0,05 | | | | | | | | |
| Cooperatieve Rabobank UA | | | | | | | | | | | |
| 4,655 % éch. 22/08/2028 | \$ 10 500 | 10 349 | 0,23 | | | | | | | | |
| 5,500 % éch. 18/07/2025 | 2 200 | 2 225 | 0,05 | | | | | | | | |
| Corebridge Global Funding | | | | | | | | | | | |
| 5,750 % éch. 02/07/2026 | 2 500 | 2 534 | 0,06 | | | | | | | | |
| CPI Property Group S.A. | | | | | | | | | | | |
| 1,750 % éch. 14/01/2030 | € 6 100 | 3 851 | 0,09 | | | | | | | | |
| 2,750 % éch. 12/05/2026 | 6 900 | 6 382 | 0,14 | | | | | | | | |
| 2,750 % éch. 22/01/2028 | £ 400 | 359 | 0,01 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026 | € 5 600 | \$ 6 300 | 0,14 | Enbridge, Inc. 5,700 % éch. 08/03/2033 | \$ 7 700 | \$ 8 007 | 0,18 | Siemens Financieringsmaatschappij NV 1,200 % éch. 11/03/2026 | \$ 2 200 | \$ 2 046 | 0,05 |
| TP ICAP Finance PLC 7,875 % éch. 17/04/2030 | £ 9 800 | 13 326 | 0,30 | Energy Transfer LP 4,500 % éch. 15/04/2024 | 5 300 | 5 281 | 0,12 | Southwest Airlines Co. 5,250 % éch. 04/05/2025 | 4 400 | 4 402 | 0,10 |
| UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024 (g) | \$ 21 200 | 21 051 | 0,48 | 6,050 % éch. 01/12/2026 | 4 100 | 4 218 | 0,10 | Sprint Spectrum Co. LLC 4,738 % éch. 20/09/2029 | 914 | 907 | 0,02 |
| UBS Group AG 3,750 % éch. 26/03/2025 | 3 070 | 3 010 | 0,07 | Entergy Louisiana LLC 2,350 % éch. 15/06/2032 | 14 000 | 11 654 | 0,26 | T-Mobile USA, Inc. 4,800 % éch. 15/07/2028 | 5 600 | 5 650 | 0,13 |
| 3,869 % éch. 12/01/2029 | 12 000 | 11 323 | 0,26 | Equifax, Inc. 5,100 % éch. 15/12/2027 | 7 800 | 7 876 | 0,18 | Thames Water Utilities Finance PLC 0,875 % éch. 31/01/2028 | € 2 100 | 1 984 | 0,04 |
| 5,125 % éch. 29/07/2026 (e)(g) | 1 300 | 1 233 | 0,03 | Expedia Group, Inc. 3,800 % éch. 15/02/2028 | 3 790 | 3 657 | 0,08 | 8,250 % éch. 25/04/2040 | £ 1 800 | 2 581 | 0,06 |
| 5,711 % éch. 12/01/2027 | 6 500 | 6 538 | 0,15 | Global Payments, Inc. 4,950 % éch. 15/08/2027 | 7 300 | 7 316 | 0,17 | Tomator Oyj 1,250 % éch. 14/10/2026 | € 5 600 | 5 795 | 0,13 |
| 6,442 % éch. 11/08/2028 | 5 650 | 5 871 | 0,13 | GN Bondco LLC 9,500 % éch. 15/10/2031 | 2 500 | 2 444 | 0,05 | Transurban Queensland Finance Pty. Ltd. 6,350 % éch. 02/05/2030 AUD | 1 500 | 1 077 | 0,02 |
| 6,537 % éch. 12/08/2033 | 13 000 | 13 881 | 0,31 | Gray Oak Pipeline LLC 3,450 % éch. 15/10/2027 | 12 600 | 11 732 | 0,27 | United Airlines Pass-Through Trust 2,875 % éch. 07/04/2030 | \$ 3 027 | 2 710 | 0,06 |
| 7,000 % éch. 30/09/2027 | £ 8 800 | 11 694 | 0,26 | HCA, Inc. 3,125 % éch. 15/03/2027 | 9 200 | 8 725 | 0,20 | 3,450 % éch. 01/06/2029 | 3 586 | 3 334 | 0,08 |
| UniCredit SpA 2,200 % éch. 22/07/2027 | € 5 450 | 5 819 | 0,13 | Hyundai Capital America 1,000 % éch. 17/09/2024 | 9 350 | 9 055 | 0,20 | 5,800 % éch. 15/07/2037 | 4 000 | 4 072 | 0,09 |
| Volkswagen Financial Services NV 1,875 % éch. 03/12/2024 | £ 3 800 | 4 683 | 0,11 | 5,500 % éch. 30/03/2026 | 6 500 | 6 537 | 0,15 | Utah Acquisition Sub, Inc. 3,950 % éch. 15/06/2026 | 6 500 | 6 285 | 0,14 |
| Vonovia SE 2,375 % éch. 25/03/2032 | € 2 100 | 2 037 | 0,05 | 5,950 % éch. 21/09/2026 | 3 600 | 3 663 | 0,08 | Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030 | 10 500 | 10 457 | 0,24 |
| Wells Fargo & Co. 2,406 % éch. 30/10/2025 | \$ 5 000 | 4 865 | 0,11 | 6,000 % éch. 11/07/2025 | 5 500 | 5 545 | 0,13 | Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028 | 3 450 | 3 487 | 0,08 |
| 3,000 % éch. 23/10/2026 | 2 550 | 2 422 | 0,05 | 6,500 % éch. 16/01/2029 | 1 100 | 1 162 | 0,03 | 8,375 % éch. 01/06/2031 | 3 450 | 3 453 | 0,08 |
| 3,196 % éch. 17/06/2027 | 2 800 | 2 678 | 0,06 | Imperial Brands Finance PLC 3,125 % éch. 26/07/2024 | 12 000 | 11 805 | 0,27 | 9,500 % éch. 01/02/2029 | 3 400 | 3 600 | 0,08 |
| 3,584 % éch. 22/05/2028 | 1 600 | 1 525 | 0,03 | 6,125 % éch. 27/07/2027 | 5 000 | 5 138 | 0,12 | Volkswagen Group of America Finance LLC 4,750 % éch. 13/11/2028 | 3 000 | 2 972 | 0,07 |
| 4,808 % éch. 25/07/2028 | 9 600 | 9 535 | 0,22 | Informa PLC 2,125 % éch. 06/10/2025 | € 15 300 | 16 442 | 0,37 | 6,333 % éch. 12/09/2025 | 12 100 | 12 129 | 0,27 |
| 6,303 % éch. 23/10/2029 | 8 100 | 8 542 | 0,19 | Intel Corp. 5,125 % éch. 10/02/2030 | \$ 6 900 | 7 161 | 0,16 | Walgreens Boots Alliance, Inc. 3,450 % éch. 01/06/2026 | 1 600 | 1 522 | 0,03 |
| Wells Fargo Bank N.A. 6,473 % éch. 11/12/2026 | 8 500 | 8 552 | 0,19 | International Business Machines Corp. 4,000 % éch. 27/07/2025 | 5 000 | 4 947 | 0,11 | | | 522 544 | 11,82 |
| Workspace Group PLC 2,250 % éch. 11/03/2028 | £ 7 600 | 8 320 | 0,19 | JDE Peet's NV 4,125 % éch. 23/01/2030 | € 12 500 | 14 219 | 0,32 | | | | |
| Yorkshire Building Society 3,511 % éch. 11/10/2030 | 2 400 | 2 742 | 0,06 | 4,500 % éch. 23/01/2034 | 6 300 | 7 326 | 0,17 | Ameren Corp. 5,000 % éch. 15/01/2029 | 8 500 | 8 544 | 0,19 |
| | | 1 067 823 | 24,16 | JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % éch. 18/05/2031 | \$ 2 174 | 1 896 | 0,04 | American Electric Power Co., Inc. 5,200 % éch. 15/01/2029 | 1 800 | 1 825 | 0,04 |
| | | | | Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026 | £ 100 | 124 | 0,00 | Avangrid, Inc. 3,800 % éch. 01/06/2029 | 2 615 | 2 467 | 0,06 |
| INDUSTRIE | | | | Marriott International, Inc. 5,550 % éch. 15/10/2028 | \$ 7 300 | 7 534 | 0,17 | Constellation Energy Generation LLC 5,600 % éch. 01/03/2028 | 6 100 | 6 287 | 0,14 |
| Amdocs Ltd. 2,538 % éch. 15/06/2030 | \$ 5 800 | 5 006 | 0,11 | Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,800 % éch. 30/03/2028 | 9 300 | 9 395 | 0,21 | DTE Energy Co. 1,050 % éch. 01/06/2025 | 2 600 | 2 452 | 0,06 |
| Babcock International Group PLC 1,375 % éch. 13/09/2027 | € 8 300 | 8 450 | 0,19 | Motorola Solutions, Inc. 2,300 % éch. 15/11/2030 | 12 400 | 10 477 | 0,24 | Edison International 3,550 % éch. 15/11/2024 | 8 060 | 7 916 | 0,18 |
| Bacardi Ltd. 4,450 % éch. 15/05/2025 | \$ 13 000 | 12 829 | 0,29 | Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | € 26 700 | 27 168 | 0,61 | EDP Finance BV 1,710 % éch. 24/01/2028 | 12 700 | 11 293 | 0,26 |
| BAT Capital Corp. 6,421 % éch. 02/08/2033 | 4 100 | 4 294 | 0,10 | NetApp, Inc. 1,875 % éch. 22/06/2025 | \$ 2 954 | 2 812 | 0,06 | Électricité de France S.A. 3,750 % éch. 05/06/2027 | € 2 800 | 3 156 | 0,07 |
| Bayer U.S. Finance LLC 6,500 % éch. 21/11/2033 | 6 700 | 6 929 | 0,16 | Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027 | 2 500 | 2 394 | 0,05 | 4,250 % éch. 25/01/2032 | 3 100 | 3 598 | 0,08 |
| Boardwalk Pipelines LP 3,400 % éch. 15/02/2031 | 7 700 | 6 885 | 0,16 | 4,810 % éch. 17/09/2030 | 15 600 | 14 594 | 0,33 | Enel Finance International NV 0,375 % éch. 28/05/2029 | 3 400 | 3 239 | 0,07 |
| Boeing Co. 2,750 % éch. 01/02/2026 | 6 400 | 6 128 | 0,14 | NTT Finance Corp. 4,239 % éch. 25/07/2025 | 2 700 | 2 672 | 0,06 | 0,875 % éch. 28/09/2034 | 9 800 | 8 169 | 0,18 |
| 3,450 % éch. 01/11/2028 | 4 200 | 3 956 | 0,09 | NXP BV 3,875 % éch. 18/06/2026 | 9 900 | 9 649 | 0,22 | 1,125 % éch. 17/10/2034 | 11 000 | 9 441 | 0,21 |
| Broadcom, Inc. 4,150 % éch. 15/11/2030 | 2 173 | 2 077 | 0,05 | OCI NV 6,700 % éch. 16/03/2033 | 2 000 | 2 044 | 0,05 | 2,875 % éch. 11/04/2029 | £ 10 000 | 11 704 | 0,27 |
| 4,300 % éch. 15/11/2032 | 4 800 | 4 607 | 0,10 | Oracle Corp. 4,500 % éch. 06/05/2028 | 4 400 | 4 402 | 0,10 | Exelon Corp. 5,150 % éch. 15/03/2028 | \$ 5 360 | 5 452 | 0,12 |
| Canadian Pacific Railway Co. 3,125 % éch. 01/06/2026 | 7 050 | 6 757 | 0,15 | 4,650 % éch. 06/05/2030 | 4 400 | 4 385 | 0,10 | Florida Power & Light Co. 5,050 % éch. 01/04/2028 | 6 500 | 6 650 | 0,15 |
| Centene Corp. 4,625 % éch. 15/12/2029 | 5 000 | 4 800 | 0,11 | Pearson Funding PLC 3,750 % éch. 04/06/2030 | £ 4 500 | 5 356 | 0,12 | Georgia Power Co. 6,135 % éch. 08/05/2025 | 8 300 | 8 320 | 0,19 |
| CenterPoint Energy Resources Corp. 5,250 % éch. 01/03/2028 | 6 100 | 6 260 | 0,14 | Rexel S.A. 2,125 % éch. 15/12/2028 | € 14 200 | 14 665 | 0,33 | Ipalco Enterprises, Inc. 3,700 % éch. 01/09/2024 | 5 500 | 5 415 | 0,12 |
| Chanel Ceres PLC 0,500 % éch. 31/07/2026 | € 10 400 | 10 715 | 0,24 | Royalty Pharma PLC 1,200 % éch. 02/09/2025 | \$ 3 000 | 2 801 | 0,06 | National Grid PLC 5,602 % éch. 12/06/2028 | 3 100 | 3 196 | 0,07 |
| Charter Communications Operating LLC 4,908 % éch. 23/07/2025 | \$ 17 900 | 17 740 | 0,40 | Sandoz Finance BV 4,220 % éch. 17/04/2030 | € 1 800 | 2 067 | 0,05 | 5,809 % éch. 12/06/2033 | 3 300 | 3 471 | 0,08 |
| Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,125 % éch. 30/06/2027 | 8 700 | 8 748 | 0,20 | 4,500 % éch. 17/11/2033 | 2 900 | 3 406 | 0,08 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,200 % éch. 02/12/2026 AUD | 2 000 | 1 270 | 0,03 |
| Choice Hotels International, Inc. 3,700 % éch. 01/12/2029 | 1 500 | 1 331 | 0,03 | Sealed Air Corp. 1,573 % éch. 15/10/2026 | \$ 4 447 | 4 008 | 0,09 | 4,900 % éch. 28/02/2028 | \$ 8 000 | 8 080 | 0,18 |
| CVS Health Corp. 5,000 % éch. 30/01/2029 | 6 000 | 6 113 | 0,14 | SEB S.A. 1,375 % éch. 16/06/2025 | € 5 000 | 5 318 | 0,12 | 6,051 % éch. 01/03/2025 | 6 400 | 6 461 | 0,15 |
| Delta Air Lines Pass-Through Trust 2,000 % éch. 10/12/2029 | 2 926 | 2 597 | 0,06 | | | | | 7,771 % éch. 15/06/2027 | 791 | 709 | 0,02 |
| eBay, Inc. 5,900 % éch. 22/11/2025 | 7 700 | 7 829 | 0,18 | | | | | Oncor Electric Delivery Co. LLC 4,300 % éch. 15/05/2028 | 5 000 | 4 943 | 0,11 |
| Emory University 2,143 % éch. 01/09/2030 | 10 400 | 8 953 | 0,20 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | | | |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|---|--|--|--|
| ONEOK, Inc. 6,625 % éch. 01/09/2053 | \$ 7 900 | \$ 8 851 | 0,20 | 4,500 % éch. 01/04/2029 - 01/07/2033 | \$ 94 | \$ 93 | 0,00 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | | | |
| Pacific Gas & Electric Co. 2,100 % éch. 01/08/2027 | 3 200 | 2 886 | 0,07 | 5,500 % éch. 01/06/2035 - 01/06/2039 | 1 728 | 1 783 | 0,04 | Obligations du Trésor américain | | | | | | |
| 3,150 % éch. 01/01/2026 | 12 500 | 11 995 | 0,27 | 5,585 % éch. 01/09/2035 | 20 | 20 | 0,00 | 1,375 % éch. 15/11/2040 \$ 163 600 \$ 108 621 2,46 | | | | | | |
| 3,300 % éch. 15/03/2027 | 2 800 | 2 620 | 0,06 | 5,643 % éch. 15/10/2043 | 3 278 | 3 198 | 0,07 | 1,375 % éch. 15/08/2050 24 100 13 436 0,30 | | | | | | |
| 3,300 % éch. 01/12/2027 | 4 800 | 4 484 | 0,10 | 5,877 % éch. 01/07/2030 | 0 | 0 | 0,00 | 1,625 % éch. 15/11/2050 35 800 21 340 0,48 | | | | | | |
| 3,400 % éch. 15/08/2024 | 5 700 | 5 607 | 0,13 | 5,942 % éch. 01/07/2027 | 0 | 0 | 0,00 | 1,750 % éch. 15/08/2041 19 500 13 570 0,31 | | | | | | |
| 3,500 % éch. 15/06/2025 | 3 600 | 3 491 | 0,08 | 5,945 % éch. 25/10/2026 | 3 243 | 3 234 | 0,07 | 1,875 % éch. 15/02/2041 2 400 1 727 0,04 | | | | | | |
| 4,650 % éch. 01/08/2028 | 2 400 | 2 307 | 0,05 | 6,000 % éch. 01/10/2027 - 01/05/2040 | 3 989 | 4 160 | 0,09 | 2,250 % éch. 15/08/2049 6 400 4 472 0,10 | | | | | | |
| 4,750 % éch. 15/02/2044 | 1 700 | 1 423 | 0,03 | 6,051 % éch. 01/11/2035 | 27 | 27 | 0,00 | 2,500 % éch. 15/02/2045 6 100 4 621 0,10 | | | | | | |
| 5,450 % éch. 15/06/2027 | 4 000 | 4 035 | 0,09 | 6,212 % éch. 25/10/2044 - 25/02/2045 | 61 | 56 | 0,00 | 2,875 % éch. 15/05/2049 3 100 2 464 0,06 | | | | | | |
| 6,400 % éch. 15/06/2033 | 8 700 | 9 163 | 0,21 | 6,357 % éch. 01/01/2028 | 0 | 0 | 0,00 | 3,000 % éch. 15/05/2042 2 900 2 454 0,06 | | | | | | |
| Southwest Gas Corp. 5,450 % éch. 23/03/2028 | 5 900 | 6 035 | 0,14 | 6,369 % éch. 01/09/2028 | 0 | 0 | 0,00 | 3,000 % éch. 15/11/2044 138 800 114 933 2,60 | | | | | | |
| TDC Net A/S 5,056 % éch. 31/05/2028 | € 5 100 | 5 866 | 0,13 | 6,412 % éch. 25/07/2044 | 97 | 91 | 0,00 | 3,000 % éch. 15/02/2049 8 100 6 594 0,15 | | | | | | |
| WEC Energy Group, Inc. 1,375 % éch. 15/10/2027 | \$ 4 525 | 4 003 | 0,09 | 6,500 % éch. 15/09/2028 | 27 | 27 | 0,00 | 3,125 % éch. 15/11/2041 15 300 13 310 0,30 | | | | | | |
| | | 206 824 | 4,68 | Ginnie Mae 2,750 % éch. 20/12/2034 | 20 | 20 | 0,00 | 3,125 % éch. 15/12/2043 5 600 4 789 0,11 | | | | | | |
| Total Obligations et billets privés | | 1 797 191 | 40,66 | 3,000 % éch. 20/10/2026 - 15/11/2049 | 871 | 778 | 0,02 | 3,125 % éch. 15/08/2044 23 500 19 908 0,45 | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX | | | | 6,500 % éch. 15/05/2042 | 27 | 27 | 0,00 | 3,250 % éch. 15/05/2042 22 800 20 014 0,45 | | | | | | |
| Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021 | | | | 3,625 % éch. 20/07/2025 - 20/07/2034 | 57 | 56 | 0,00 | 3,375 % éch. 15/08/2042 30 400 27 120 0,61 | | | | | | |
| 3,714 % éch. 01/06/2041 | 1 300 | 994 | 0,02 | 3,875 % éch. 20/04/2030 | 4 | 4 | 0,00 | 3,375 % éch. 15/05/2044 47 300 41 722 0,94 | | | | | | |
| Billets JobsOhio Beverage System Revenue Notes, Series 2023 | | | | 4,000 % éch. 15/02/2052 | 1 616 | 1 550 | 0,04 | 3,625 % éch. 15/02/2044 24 700 22 641 0,51 | | | | | | |
| 4,433 % éch. 01/01/2033 | 5 350 | 5 310 | 0,12 | 5,000 % éch. 15/03/2034 - 15/07/2048 | 903 | 908 | 0,02 | 3,750 % éch. 15/08/2041 18 600 17 705 0,40 | | | | | | |
| Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020 | | | | 5,616 % éch. 20/06/2067 | 2 860 | 2 864 | 0,07 | 3,750 % éch. 15/11/2043 5 000 4 675 0,11 | | | | | | |
| 3,301 % éch. 01/06/2033 | 7 125 | 5 873 | 0,14 | 5,838 % éch. 20/01/2072 | 4 230 | 4 093 | 0,09 | 3,875 % éch. 15/05/2043 38 100 36 335 0,82 | | | | | | |
| Billets University of California Revenue Notes, Series 2020 | | | | 5,909 % éch. 20/09/2065 | 902 | 897 | 0,02 | 4,000 % éch. 15/11/2042 13 425 13 051 0,29 | | | | | | |
| 0,883 % éch. 15/05/2025 | 5 500 | 5 219 | 0,12 | 5,957 % éch. 20/08/2062 | 575 | 573 | 0,01 | 4,000 % éch. 15/11/2052 24 500 24 178 0,55 | | | | | | |
| | | 17 396 | 0,40 | 6,000 % éch. 20/09/2038 | 3 | 3 | 0,00 | 4,375 % éch. 15/11/2039 10 100 10 525 0,24 | | | | | | |
| AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | | 6,037 % éch. 20/08/2065 | 15 430 | 15 306 | 0,35 | 4,375 % éch. 15/08/2043 18 000 18 380 0,42 | | | | | | |
| Fannie Mae | | | | 6,088 % éch. 20/10/2072 | 5 793 | 5 743 | 0,13 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) | | | | | | |
| 3,150 % éch. 01/08/2027 | 932 | 895 | 0,02 | 6,138 % éch. 20/01/2073 | 7 699 | 7 627 | 0,17 | 0,125 % éch. 15/10/2024 40 653 39 770 0,90 | | | | | | |
| 4,246 % éch. 01/03/2036 | 8 | 8 | 0,00 | 6,208 % éch. 20/01/2073 | 13 673 | 13 588 | 0,31 | 0,125 % éch. 15/04/2025 20 894 20 150 0,46 | | | | | | |
| 4,287 % éch. 01/04/2033 | 5 | 5 | 0,00 | 6,218 % éch. 20/02/2073 | 17 644 | 17 554 | 0,40 | 0,125 % éch. 15/07/2031 18 252 16 236 0,37 | | | | | | |
| 4,312 % éch. 01/12/2034 | 23 | 23 | 0,00 | 6,237 % éch. 20/01/2066 | 7 622 | 7 584 | 0,17 | 0,125 % éch. 15/01/2032 14 096 12 388 0,28 | | | | | | |
| 4,323 % éch. 01/03/2036 | 8 | 8 | 0,00 | 6,238 % éch. 20/01/2073 | 26 773 | 26 666 | 0,60 | 0,125 % éch. 15/02/2051 51 171 31 723 0,72 | | | | | | |
| 4,393 % éch. 01/01/2036 | 8 | 8 | 0,00 | 6,358 % éch. 20/12/2072 | 5 195 | 5 207 | 0,12 | 0,125 % éch. 15/02/2052 2 432 1 493 0,03 | | | | | | |
| 4,793 % éch. 25/12/2042 | 51 | 49 | 0,00 | 6,478 % éch. 20/11/2072 | 10 047 | 10 133 | 0,23 | 0,250 % éch. 15/01/2025 15 015 14 576 0,33 | | | | | | |
| 4,913 % éch. 01/09/2035 | 43 | 43 | 0,00 | 6,859 % éch. 20/11/2067 | 5 662 | 5 709 | 0,13 | 0,250 % éch. 15/02/2050 8 138 5 313 0,12 | | | | | | |
| 5,000 % éch. 25/04/2033 - 25/06/2043 | 131 | 130 | 0,00 | 8,000 % éch. 20/05/2031 | 4 | 4 | 0,00 | 0,500 % éch. 15/04/2024 10 491 10 359 0,23 | | | | | | |
| 5,095 % éch. 01/07/2035 | 11 | 11 | 0,00 | Ginnie Mae, TBA 2,000 % éch. 01/01/2054 | 15 100 | 12 788 | 0,29 | 0,625 % éch. 15/07/2032 16 520 15 102 0,34 | | | | | | |
| 5,260 % éch. 25/05/2035 | 22 | 23 | 0,00 | 4,000 % éch. 01/01/2054 | 11 300 | 10 807 | 0,24 | 0,625 % éch. 15/02/2043 134 105 0,00 | | | | | | |
| 5,410 % éch. 01/07/2035 | 5 | 5 | 0,00 | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 13 000 | 12 784 | 0,29 | 0,750 % éch. 15/02/2045 26 001 20 352 0,46 | | | | | | |
| 5,456 % éch. 01/05/2038 | 2 298 | 2 364 | 0,05 | Administration des petites entreprises 5,870 % éch. 01/07/2028 | | | | 6 | 6 | 0,00 | 0,875 % éch. 15/02/2047 8 285 6 537 0,15 | | | |
| 5,503 % éch. 25/12/2036 | 36 | 35 | 0,00 | 6,220 % éch. 01/12/2028 | 348 | 351 | 0,01 | 1,000 % éch. 15/02/2046 779 638 0,01 | | | | | | |
| 5,522 % éch. 01/11/2035 | 26 | 26 | 0,00 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) | | | | | | | 1,000 % éch. 15/02/2049 2 690 2 168 0,05 | | | |
| 5,563 % éch. 25/03/2034 | 2 | 2 | 0,00 | 3,000 % éch. 01/03/2028 - 01/07/2052 | 156 325 | 138 375 | 3,13 | 1,250 % éch. 15/04/2028 14 155 13 791 0,31 | | | | | | |
| 5,624 % éch. 01/09/2034 | 97 | 97 | 0,00 | 3,500 % éch. 01/01/2047 - 01/08/2052 | 17 118 | 15 711 | 0,36 | 1,375 % éch. 15/02/2044 792 709 0,02 | | | | | | |
| 5,681 % éch. 01/05/2037 | 83 | 82 | 0,00 | 4,000 % éch. 01/04/2024 - 01/10/2052 | 23 555 | 22 716 | 0,51 | 1,500 % éch. 15/02/2053 2 174 1 973 0,05 | | | | | | |
| 5,692 % éch. 25/07/2037 | 176 | 171 | 0,00 | 4,500 % éch. 01/06/2024 - 01/05/2053 | 16 566 | 16 089 | 0,36 | Billets du Trésor américain 1,750 % éch. 30/06/2024 | | | | | | |
| 5,739 % éch. 01/06/2035 | 192 | 198 | 0,00 | 5,000 % éch. 01/10/2031 - 01/11/2053 | 182 025 | 180 298 | 4,08 | 16 700 16 422 0,37 | | | | | | |
| 5,754 % éch. 25/06/2034 | 246 | 242 | 0,01 | 5,500 % éch. 01/01/2025 - 01/04/2053 | 2 810 | 2 889 | 0,07 | STRIPS du Trésor américain 0,000 % éch. 15/05/2042 (b) | | | | | | |
| 5,802 % éch. 25/09/2042 | 377 | 377 | 0,01 | 6,000 % éch. 01/05/2024 - 01/02/2041 | 1 305 | 1 359 | 0,03 | 7 900 3 528 0,08 | | | | | | |
| 5,900 % éch. 25/07/2042 | 31 | 31 | 0,00 | 6,500 % éch. 01/07/2034 - 01/03/2037 | 63 | 67 | 0,00 | 801 918 18,14 | | | | | | |
| 5,922 % éch. 01/09/2035 | 3 | 3 | 0,00 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | | | | | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| 5,941 % éch. 01/09/2039 | 11 | 11 | 0,00 | 2,500 % éch. 01/02/2054 | 50 400 | 42 938 | 0,97 | American Home Mortgage Investment Trust 5,830 % éch. 25/12/2046 | | | | | | |
| 5,951 % éch. 01/09/2034 | 8 | 8 | 0,00 | 3,000 % éch. 01/02/2054 | 380 688 | 337 311 | 7,63 | 119 96 0,00 | | | | | | |
| 5,956 % éch. 01/09/2035 | 13 | 12 | 0,00 | 3,500 % éch. 01/02/2054 | 365 600 | 335 781 | 7,60 | Angel Oak Mortgage Trust 1,469 % éch. 25/06/2065 | | | | | | |
| 6,002 % éch. 25/09/2041 | 1 323 | 1 312 | 0,03 | 4,000 % éch. 01/01/2054 | 319 199 | 302 137 | 6,84 | 854 798 0,02 | | | | | | |
| 6,021 % éch. 01/11/2034 | 24 | 25 | 0,00 | 4,500 % éch. 01/02/2039 - 01/02/2054 | 189 100 | 183 437 | 4,15 | Ashford Hospitality Trust 6,534 % éch. 15/06/2035 | | | | | | |
| 6,129 % éch. 01/10/2044 | 11 | 11 | 0,00 | 5,000 % éch. 01/01/2054 | 357 100 | 353 391 | 8,00 | 2 740 2 701 0,06 | | | | | | |
| 6,215 % éch. 01/11/2025 | 0 | 0 | 0,00 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 137 200 | 137 822 | 3,12 | Atrium Hotel Portfolio Trust 6,609 % éch. 15/06/2035 | | | | | | |
| 6,329 % éch. 01/10/2040 | 7 | 7 | 0,00 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 8 500 | 8 631 | 0,20 | 6 900 6 831 0,16 | | | | | | |
| 6,352 % éch. 25/04/2032 | 6 | 6 | 0,00 | Banc of America Funding Trust 4,772 % éch. 25/05/2035 | | | | 1 225 | 1 134 | 0,03 | Banc of America Merrill Lynch Trust 3,218 % éch. 14/04/2033 | | | |
| Freddie Mac 0,650 % éch. 22/10/2025 | 83 800 | 78 229 | 1,77 | 4,817 % éch. 20/09/2035 | | | | 781 | 616 | 0,01 | 5 500 5 255 0,12 | | | |
| 0,795 % éch. 15/03/2044 | 7 576 | 6 521 | 0,15 | Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,231 % éch. 15/09/2060 | | | | 10 900 | 10 525 | 0,24 | Banc of America Mortgage Trust 5,217 % éch. 25/07/2035 | | | |
| 0,800 % éch. 28/10/2026 | 13 600 | 12 356 | 0,28 | Banc of America Mortgage Trust 5,267 % éch. 25/07/2034 | | | | 142 | 127 | 0,00 | 5 217 188 175 0,00 | | | |
| 2,000 % éch. 15/06/2052 (a) | 28 189 | 3 492 | 0,08 | BankUnited Trust 6,070 % éch. 25/09/2045 | | | | 663 | 600 | 0,01 | 5,267 142 127 0,00 | | | |
| 2,750 % éch. 15/09/2040 | 252 | 234 | 0,01 | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 4,314 % éch. 15/12/2051 | | | | 8 000 | 7 741 | 0,18 | 6,070 663 600 0,01 | | | |
| 4,000 % éch. 01/10/2029 - 01/10/2047 | 779 | 756 | 0,02 | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,910 % éch. 25/04/2034 | | | | 186 | 152 | 0,00 | 4,314 8 000 7 741 0,18 | | | |
| | | | | 4,022 % éch. 25/04/2034 | | | | 87 | 80 | 0,00 | 3,910 186 152 0,00 | | | |

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 4,088 % éch. 25/04/2034 | \$ 159 | \$ 141 | 0,00 | 5,500 % éch. 25/01/2037 | \$ 8 | \$ 19 | 0,00 | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust | | | |
| 4,746 % éch. 25/07/2034 | 6 | 5 | 0,00 | HarborView Mortgage Loan Trust | | | | 3,440 % éch. 25/02/2036 | \$ 761 | \$ 665 | 0,02 |
| 4,815 % éch. 25/11/2030 | 1 | 1 | 0,00 | 5,730 % éch. 19/03/2037 | 3 074 | 2 732 | 0,06 | 5,882 % éch. 25/04/2034 | 1 096 | 1 083 | 0,03 |
| 5,308 % éch. 25/04/2033 | 11 | 10 | 0,00 | 5,910 % éch. 19/05/2035 | 157 | 143 | 0,00 | 5,926 % éch. 25/09/2034 | 146 | 138 | 0,00 |
| 5,453 % éch. 25/02/2034 | 62 | 57 | 0,00 | IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust | | | | Structured Asset Mortgage Investments Trust | | | |
| 5,820 % éch. 25/01/2034 | 137 | 135 | 0,00 | 5,545 % éch. 25/01/2032 | 0 | 0 | 0,00 | 5,910 % éch. 25/09/2047 | 9 967 | 8 586 | 0,19 |
| 5,877 % éch. 25/12/2035 | 80 | 77 | 0,00 | IndyMac Mortgage Loan Trust | | | | 5,950 % éch. 19/04/2035 | 212 | 200 | 0,00 |
| Bear Stearns ALT-A Trust | | | | 5,950 % éch. 25/06/2037 | 969 | 882 | 0,02 | 5,970 % éch. 19/07/2035 | 146 | 140 | 0,00 |
| 4,488 % éch. 25/05/2035 | 353 | 334 | 0,01 | JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust | | | | 6,030 % éch. 25/02/2036 | 409 | 336 | 0,01 |
| 4,730 % éch. 25/09/2035 | 390 | 231 | 0,01 | 3,358 % éch. 15/11/2048 | 7 166 | 7 008 | 0,16 | 6,050 % éch. 19/05/2034 | 129 | 117 | 0,00 |
| 5,790 % éch. 25/02/2034 | 40 | 38 | 0,00 | JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust | | | | 6,130 % éch. 19/09/2032 | 15 | 15 | 0,00 |
| Benchmark Mortgage Trust | | | | 2,994 % éch. 15/12/2049 | 7 119 | 6 850 | 0,16 | 6,320 % éch. 25/05/2047 | 7 278 | 5 873 | 0,13 |
| 3,666 % éch. 15/01/2051 | 11 100 | 10 388 | 0,24 | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust | | | | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust | | | |
| 3,965 % éch. 10/04/2051 | 5 454 | 5 317 | 0,12 | 6,619 % éch. 15/06/2035 | 10 951 | 9 797 | 0,22 | 7,500 % éch. 25/10/2036 | 637 | 384 | 0,01 |
| Citigroup Commercial Mortgage Trust | | | | JPMorgan Mortgage Trust | | | | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates | | | |
| 3,251 % éch. 10/05/2035 | 7 853 | 7 419 | 0,17 | 4,538 % éch. 25/07/2035 | 115 | 108 | 0,00 | 7,323 % éch. 25/06/2033 | 2 | 2 | 0,00 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust | | | | 5,750 % éch. 25/01/2036 | 337 | 157 | 0,00 | Thornburg Mortgage Securities Trust | | | |
| 4,523 % éch. 25/09/2037 | 92 | 81 | 0,00 | Landmark Mortgage Securities PLC | | | | 3,875 % éch. 25/09/2037 | 2 438 | 2 360 | 0,05 |
| 7,780 % éch. 25/10/2035 | 31 | 30 | 0,00 | 5,620 % éch. 17/04/2044 | £ 6 068 | 7 532 | 0,17 | 6,815 % éch. 25/06/2047 | 1 846 | 1 555 | 0,04 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | Lehman XS Trust | | | | Towd Point Mortgage Funding PLC | | | |
| 7,198 % éch. 25/09/2035 | 841 | 839 | 0,02 | 5,830 % éch. 25/12/2036 | \$ 3 663 | 3 509 | 0,08 | 6,365 % éch. 20/10/2051 | £ 8 268 | 10 551 | 0,24 |
| Commercial Mortgage Trust | | | | 5,870 % éch. 25/03/2047 | 10 467 | 8 937 | 0,20 | 6,571 % éch. 20/07/2045 | 16 545 | 21 150 | 0,48 |
| 3,144 % éch. 10/03/2048 | 2 168 | 2 145 | 0,05 | London Wall Mortgage Capital PLC | | | | Tower Bridge Funding PLC | | | |
| 3,545 % éch. 10/02/2036 | 11 300 | 10 554 | 0,24 | 6,020 % éch. 15/05/2052 | £ 1 090 | 1 383 | 0,03 | 6,000 % éch. 20/11/2063 | 3 955 | 5 031 | 0,11 |
| 3,590 % éch. 10/11/2047 | 12 200 | 11 946 | 0,27 | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust | | | | Trinity Square PLC | | | |
| Countrywide Alternative Loan Trust | | | | 4,889 % éch. 25/01/2036 | \$ 7 | 7 | 0,00 | 6,070 % éch. 15/07/2059 | 9 332 | 11 896 | 0,27 |
| 3,810 % éch. 25/11/2035 | 6 634 | 6 167 | 0,14 | 5,386 % éch. 21/11/2034 | 1 572 | 1 478 | 0,03 | Tudor Rose Mortgages | | | |
| 5,500 % éch. 25/02/2036 | 2 787 | 2 192 | 0,05 | MASTR Reperforming Loan Trust | | | | 5,820 % éch. 20/06/2048 | 412 | 522 | 0,01 |
| 5,500 % éch. 25/05/2036 | 1 781 | 1 466 | 0,03 | 7,000 % éch. 25/05/2035 | 515 | 360 | 0,01 | Twin Bridges PLC | | | |
| 5,750 % éch. 25/02/2037 | 3 195 | 1 697 | 0,04 | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust | | | | 6,470 % éch. 12/12/2054 | 2 776 | 3 544 | 0,08 |
| 6,000 % éch. 25/02/2036 | 4 659 | 2 726 | 0,06 | 4,340 % éch. 25/02/2035 | 645 | 614 | 0,01 | Uropa Securities PLC | | | |
| 6,000 % éch. 25/04/2036 | 187 | 91 | 0,00 | 4,407 % éch. 25/06/2035 | 283 | 269 | 0,01 | 5,540 % éch. 10/10/2040 | 454 | 561 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/08/2036 | 5 828 | 3 703 | 0,08 | 5,970 % éch. 25/11/2035 | 211 | 197 | 0,01 | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/11/2036 | 252 | 139 | 0,00 | Mettlife Securitization Trust | | | | 3,374 % éch. 25/01/2037 | \$ 3 826 | 3 352 | 0,08 |
| 6,000 % éch. 25/08/2037 | 3 748 | 2 404 | 0,05 | Mortgage Equity Conversion Asset Trust | | | | 3,787 % éch. 25/02/2037 | 611 | 556 | 0,01 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | 5,340 % éch. 25/05/2042 | 2 832 | 2 713 | 0,06 | 4,238 % éch. 25/09/2036 | 948 | 839 | 0,02 |
| 4,125 % éch. 19/07/2031 | 0 | 0 | 0,00 | MortgageIT Trust | | | | 6,010 % éch. 25/07/2045 | 304 | 285 | 0,01 |
| 4,587 % éch. 20/10/2035 | 1 141 | 1 132 | 0,03 | 6,030 % éch. 25/10/2035 | 571 | 555 | 0,01 | 6,050 % éch. 25/10/2045 | 2 868 | 2 729 | 0,06 |
| 4,765 % éch. 25/11/2034 | 338 | 307 | 0,01 | NAAC Reperforming Loan REMIC Trust | | | | 6,090 % éch. 25/01/2045 | 124 | 120 | 0,00 |
| 5,003 % éch. 20/02/2035 | 81 | 80 | 0,00 | 7,000 % éch. 25/10/2034 | 425 | 380 | 0,01 | 6,110 % éch. 25/01/2045 | 1 494 | 1 405 | 0,03 |
| 5,870 % éch. 25/04/2046 | 782 | 728 | 0,02 | 7,500 % éch. 25/03/2034 | 553 | 498 | 0,01 | Warwick Finance Residential Mortgages PLC | | | |
| 6,000 % éch. 25/07/2037 | 250 | 118 | 0,00 | NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates | | | | 0,000 % éch. 21/12/2049 (b) | £ 0 | 1 629 | 0,04 |
| 7,884 % éch. 20/02/2036 | 45 | 39 | 0,00 | 6,500 % éch. 25/02/2035 | 1 782 | 1 494 | 0,03 | 6,170 % éch. 21/12/2049 | 8 117 | 10 375 | 0,24 |
| Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust | | | | Natixis Commercial Mortgage Securities Trust | | | | 6,870 % éch. 21/12/2049 | 2 030 | 2 566 | 0,06 |
| 4,415 % éch. 25/01/2034 | 14 | 12 | 0,00 | 3,790 % éch. 15/11/2032 | 8 000 | 6 792 | 0,15 | 7,370 % éch. 21/12/2049 | 1 015 | 1 276 | 0,03 |
| 5,810 % éch. 25/06/2035 | 102 | 95 | 0,00 | New Residential Mortgage Loan Trust | | | | 7,870 % éch. 21/12/2049 | 580 | 727 | 0,02 |
| 6,500 % éch. 25/11/2034 | 21 | 20 | 0,00 | 3,500 % éch. 25/12/2057 | 5 307 | 5 080 | 0,12 | 8,370 % éch. 21/12/2049 | 580 | 714 | 0,02 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust | | | | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | |
| 4,631 % éch. 25/06/2033 | 3 | 3 | 0,00 | 6,540 % éch. 25/02/2035 | 362 | 352 | 0,01 | 5,500 % éch. 25/05/2035 | \$ 517 | 416 | 0,01 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates | | | | Paragon Mortgages PLC | | | | 6,000 % éch. 25/11/2035 | 456 | 379 | 0,01 |
| 6,000 % éch. 25/11/2035 | 2 322 | 625 | 0,01 | 4,242 % éch. 15/11/2038 | € 500 | 542 | 0,01 | Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates | | | | Precise Mortgage Funding PLC | | | | 3,770 % éch. 25/02/2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,500 % éch. 26/04/2038 | 706 | 686 | 0,02 | 0,000 % éch. 12/12/2055 (b) | £ 0 | 393 | 0,01 | | | | 376 708 8,52 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust | | | | Prime Mortgage Trust | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | |
| 5,750 % éch. 25/04/2036 | 763 | 411 | 0,01 | 5,870 % éch. 25/02/2034 | \$ 59 | 55 | 0,00 | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | |
| 6,000 % éch. 25/05/2036 | 1 869 | 1 066 | 0,02 | Primrose Residential DAC | | | | 5,590 % éch. 25/10/2036 | 226 | 84 | 0,00 |
| 6,000 % éch. 25/04/2037 | 562 | 212 | 0,01 | 4,626 % éch. 24/03/2061 | € 11 685 | 12 868 | 0,29 | 5,790 % éch. 25/08/2036 | 6 199 | 1 517 | 0,04 |
| CSAIL Commercial Mortgage Trust | | | | Residential Accredited Loans, Inc. Trust | | | | Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | |
| 3,458 % éch. 15/11/2050 | 4 600 | 4 199 | 0,10 | 5,870 % éch. 25/05/2037 | \$ 2 328 | 1 662 | 0,04 | 6,175 % éch. 25/01/2036 | 182 | 182 | 0,00 |
| DBGS Mortgage Trust | | | | 6,000 % éch. 25/04/2036 | 2 467 | 1 948 | 0,04 | 6,400 % éch. 25/05/2035 | 2 523 | 2 488 | 0,06 |
| 6,254 % éch. 15/06/2033 | 2 000 | 1 838 | 0,04 | Residential Asset Securitization Trust | | | | 6,490 % éch. 25/10/2034 | 931 | 920 | 0,02 |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust | | | | 6,500 % éch. 25/09/2036 | 708 | 243 | 0,01 | 6,580 % éch. 25/03/2035 | 4 169 | 4 074 | 0,09 |
| 5,800 % éch. 25/08/2037 | 2 435 | 1 928 | 0,04 | Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust | | | | Armada Euro CLO DAC | | | |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust | | | | 5,834 % éch. 25/02/2036 | 120 | 106 | 0,00 | 4,685 % éch. 15/07/2031 | € 11 936 | 13 045 | 0,30 |
| 6,046 % éch. 19/07/2044 | 9 | 8 | 0,00 | Resolc UK PLC | | | | Asset-Backed Funding Certificates Trust | | | |
| Eurohome UK Mortgages PLC | | | | 5,499 % éch. 15/12/2043 | £ 3 413 | 4 209 | 0,10 | 6,170 % éch. 25/06/2034 | \$ 89 | 87 | 0,00 |
| 5,490 % éch. 15/06/2044 | £ 1 422 | 1 787 | 0,04 | Ripon Mortgages PLC | | | | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust | | | |
| First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust | | | | 5,920 % éch. 28/08/2056 | 12 036 | 15 298 | 0,35 | 4,120 % éch. 25/12/2036 | 1 886 | 1 836 | 0,04 |
| 6,000 % éch. 25/06/2037 | \$ 1 132 | 413 | 0,01 | RMAC PLC | | | | Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | |
| 6,222 % éch. 25/10/2034 | 77 | 73 | 0,00 | 0,000 % éch. 15/02/2047 | 10 700 | 13 685 | 0,31 | 6,805 % éch. 16/01/2030 | 7 013 | 7 004 | 0,16 |
| GS Mortgage Securities Corp. Trust | | | | RMAC Securities PLC | | | | Avoca CLO DAC | | | |
| 6,593 % éch. 15/07/2025 | 3 810 | 3 781 | 0,09 | 5,769 % éch. 12/06/2044 | 706 | 851 | 0,02 | 4,655 % éch. 15/07/2030 | € 7 729 | 8 494 | 0,19 |
| GSR Mortgage Loan Trust | | | | Stratton Mortgage Funding PLC | | | | 4,785 % éch. 15/10/2032 | 5 200 | 5 674 | 0,13 |
| 4,240 % éch. 25/06/2034 | 51 | 48 | 0,00 | 6,121 % éch. 20/07/2060 | 13 543 | 17 262 | 0,39 | | | | |
| 4,381 % éch. 25/06/2034 | 18 | 17 | 0,00 | | | | | | | | |
| 4,630 % éch. 25/01/2036 | 1 112 | 1 021 | 0,02 | | | | | | | | |
| 4,836 % éch. 25/09/2035 | 1 369 | 1 287 | 0,03 | | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Baring's CLO Ltd. 6,605 % éch. 15/04/2031 | \$ 12 517 | \$ 12 505 | 0,28 | Massachusetts Educational Financing Authority 6,590 % éch. 25/04/2038 | \$ 4 | \$ 4 | 0,00 | Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 0,875 % éch. 21/03/2046 | € 10 000 | \$ 6 851 | 0,16 |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,356 % éch. 25/05/2035 | 106 | 105 | 0,00 | Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust 6,720 % éch. 25/10/2037 | 9 085 | 7 520 | 0,17 | Obligation internationale du gouvernement paraguayen 4,950 % éch. 28/04/2031 | \$ 2 300 | 2 251 | 0,05 |
| 5,383 % éch. 25/12/2035 | 1 042 | 1 034 | 0,02 | MF1 LLC 7,506 % éch. 19/06/2037 | 11 300 | 11 287 | 0,26 | Province de l'Ontario 1,850 % éch. 01/02/2027 | CAD 7 000 | 5 031 | 0,11 |
| 6,670 % éch. 25/01/2045 | 80 | 80 | 0,00 | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,650 % éch. 25/05/2037 | 527 | 447 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement roumain 3,000 % éch. 27/02/2027 | \$ 12 000 | 11 200 | 0,25 |
| Black Diamond CLO DAC 4,982 % éch. 15/05/2032 | € 11 725 | 12 789 | 0,29 | 5,670 % éch. 25/09/2036 | 946 | 334 | 0,01 | Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/07/2033 | £ 1 300 | 1 298 | 0,03 |
| Blackrock European CLO DAC 4,585 % éch. 15/10/2031 | 12 766 | 13 882 | 0,31 | 5,700 % éch. 25/11/2036 | 923 | 526 | 0,01 | | | 189 110 | 4,28 |
| BlueMountain CLO Ltd. 6,854 % éch. 22/10/2030 | \$ 760 | 760 | 0,02 | 5,770 % éch. 25/07/2036 | 7 623 | 2 848 | 0,07 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 4,615 % éch. 15/07/2030 | € 1 357 | 1 492 | 0,03 | 5,790 % éch. 25/09/2036 | 7 615 | 3 257 | 0,07 | BILLETTS DE TRÉSORERIE | | | |
| BNPP AM Euro CLO DAC 4,822 % éch. 22/07/2032 | 12 000 | 13 084 | 0,30 | 6,175 % éch. 25/01/2035 | 1 476 | 1 424 | 0,03 | AT+T, Inc. 5,700 % éch. 19/03/2024 | | | |
| Bosphorus CLO DAC 4,745 % éch. 15/12/2030 | 163 | 178 | 0,00 | New Century Home Equity Loan Trust 5,830 % éch. 25/05/2036 | 41 | 41 | 0,00 | \$ 11 000 | | | |
| Bridgepoint CLO DAC 5,175 % éch. 15/01/2034 | 1 000 | 1 097 | 0,03 | 6,190 % éch. 25/10/2035 | 3 148 | 3 026 | 0,07 | 10 862 | | | |
| Cairn CLO DAC 4,552 % éch. 30/04/2031 | 12 302 | 13 431 | 0,30 | OZLM Ltd. 6,744 % éch. 17/04/2031 | 9 504 | 9 500 | 0,22 | BILLETTS À COURT TERME | | | |
| Carlyle Euro CLO DAC 4,632 % éch. 15/08/2030 | 7 811 | 8 551 | 0,19 | 6,902 % éch. 30/10/2030 | 6 428 | 6 437 | 0,15 | BGC Group, Inc. 3,750 % éch. 01/10/2024 | | | |
| Carrington Mortgage Loan Trust 6,460 % éch. 25/06/2035 | \$ 770 | 755 | 0,02 | Palmer Square European Loan Funding DAC 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 10 167 | 11 053 | 0,25 | 1 168 | | | |
| CIFC Funding Ltd. 6,844 % éch. 16/11/2030 | 1 245 | 1 246 | 0,03 | Palmerston Park CLO DAC 4,625 % éch. 18/04/2030 | 4 187 | 4 604 | 0,10 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust 5,790 % éch. 25/09/2036 | 4 418 | 3 209 | 0,07 | Purple Finance CLO DAC 4,756 % éch. 25/01/2031 | 394 | 434 | 0,01 | 10,900 % éch. 04/01/2024 (b)(c) HUF 3 394 000 | | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,720 % éch. 25/03/2037 | 1 791 | 1 473 | 0,03 | Renaissance Home Equity Loan Trust 6,670 % éch. 25/11/2034 | \$ 127 | 111 | 0,00 | 9 803 | | | |
| Commonbond Student Loan Trust 6,320 % éch. 25/05/2041 | 496 | 487 | 0,01 | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,710 % éch. 25/11/2036 | 5 807 | 1 661 | 0,04 | 21 833 | | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,610 % éch. 25/06/2047 | 1 609 | 1 449 | 0,03 | 5,750 % éch. 25/05/2036 | 429 | 225 | 0,01 | Total des Valeurs mobilières | | | |
| 5,690 % éch. 25/09/2037 | 1 033 | 1 053 | 0,02 | Starwood Commercial Mortgage Trust 6,556 % éch. 15/07/2038 | 4 362 | 4 316 | 0,10 | \$ 5 908 989 | | | |
| 5,700 % éch. 25/07/2037 | 1 000 | 849 | 0,02 | Structured Asset Investment Loan Trust 5,850 % éch. 25/03/2036 | 433 | 421 | 0,01 | ACTIONS | | | |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 6,325 % éch. 25/08/2034 | 163 | 163 | 0,00 | 6,235 % éch. 25/08/2035 | 443 | 425 | 0,01 | FONDS D'INVESTISSEMENT | | | |
| 6,370 % éch. 25/10/2034 | 795 | 780 | 0,02 | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,625 % éch. 25/09/2036 | 6 976 | 4 331 | 0,10 | ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 5,749 % éch. 25/05/2046 | 1 627 | 1 378 | 0,03 | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. 5,102 % éch. 01/04/2035 | 6 400 | 6 528 | 0,15 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities F und (f) | | | |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 5,590 % éch. 25/11/2036 | 114 | 51 | 0,00 | Venture CLO Ltd. 6,777 % éch. 20/01/2029 | 10 418 | 10 422 | 0,24 | 981 265 | | | |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,555 % éch. 15/09/2031 | € 12 945 | 14 084 | 0,32 | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust 5,830 % éch. 25/04/2037 | 4 889 | 1 855 | 0,04 | 11 079 | | | |
| FBR Securitization Trust 6,175 % éch. 25/11/2035 | \$ 4 180 | 4 077 | 0,09 | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 6,470 % éch. 25/10/2034 | 1 054 | 1 046 | 0,02 | 99 770 | | | |
| First Franklin Mortgage Loan Trust 5,690 % éch. 25/12/2037 | 3 751 | 3 542 | 0,08 | | 341 773 | 7,73 | | 2,25 | | | |
| 6,145 % éch. 25/03/2034 | 316 | 312 | 0,01 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | | |
| 6,745 % éch. 25/07/2034 | 444 | 436 | 0,01 | Action Logement Services 0,500 % éch. 30/10/2034 | € 7 600 | 6 458 | 0,15 | | | | |
| GE-WMC Mortgage Securities Trust 5,550 % éch. 25/08/2036 | 33 | 14 | 0,00 | Airport Authority Hong Kong 4,750 % éch. 12/01/2028 | \$ 1 300 | 1 315 | 0,03 | | | | |
| Griffith Park CLO DAC 4,704 % éch. 21/11/2031 | € 11 949 | 12 991 | 0,29 | 4,875 % éch. 12/01/2030 | 5 000 | 5 087 | 0,12 | | | | |
| GSAMP Trust 5,610 % éch. 25/12/2036 | \$ 11 907 | 6 261 | 0,14 | Obligation internationale du gouvernement canadien 2,250 % éch. 01/12/2029 | CAD 38 600 | 28 023 | 0,63 | | | | |
| 5,710 % éch. 25/01/2037 | 405 | 233 | 0,01 | Development Bank of Japan, Inc. 0,010 % éch. 15/10/2024 | € 6 600 | 7 090 | 0,16 | | | | |
| Harvest CLO DAC 4,815 % éch. 15/01/2032 | € 13 700 | 14 941 | 0,34 | 0,875 % éch. 10/10/2025 | 4 300 | 4 575 | 0,10 | | | | |
| Home Equity Asset Trust 6,070 % éch. 25/07/2036 | \$ 4 678 | 4 266 | 0,10 | Union européenne 0,000 % éch. 04/10/2028 (b) | 1 678 | 1 655 | 0,04 | | | | |
| 6,505 % éch. 25/08/2035 | 113 | 109 | 0,00 | Obligation internationale du gouvernement hongrois 1,750 % éch. 05/06/2035 | 10 000 | 8 503 | 0,19 | | | | |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust 6,010 % éch. 25/12/2035 | 443 | 441 | 0,01 | Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | 4 000 | 4 522 | 0,10 | | | | |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,905 % éch. 25/05/2036 | 3 585 | 3 371 | 0,08 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % éch. 15/05/2028 (d) | 44 554 | 49 199 | 1,11 | | | | |
| Jubilee CLO DAC 4,575 % éch. 15/04/2030 | € 18 890 | 20 744 | 0,47 | Japan Finance Organization for Municipalities 0,010 % éch. 02/02/2028 | 9 900 | 9 792 | 0,22 | | | | |
| Madison Park Euro Funding DAC 4,715 % éch. 15/01/2032 | 12 300 | 13 389 | 0,30 | Banque de développement coréenne 6,069 % éch. 23/10/2026 | \$ 1 800 | 1 809 | 0,04 | | | | |
| Man GLG Euro CLO DAC 4,615 % éch. 15/12/2031 | 10 249 | 11 193 | 0,25 | Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 (d) MXN 185 093 | 9 651 | 9 651 | 0,22 | | | | |
| | | | | 3,000 % éch. 03/12/2026 (d) | 55 712 | 3 056 | 0,07 | | | | |
| | | | | 4,000 % éch. 30/11/2028 (d) | 101 366 | 5 854 | 0,13 | | | | |
| | | | | 8,500 % éch. 01/03/2029 | 188 000 | 10 847 | 0,25 | | | | |
| | | | | 8,500 % éch. 31/05/2029 | 87 000 | 5 043 | 0,12 | | | | |
| | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement | | | |
| | | | | | | | | \$ 151 381 | | | |
| | | | | | | | | 3,42 | | | |

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 732 | Billets du Trésor américain 4,875 % échéance 30/11/2025 | \$ (747) | \$ 732 | \$ 732 | 0,02 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (747) | \$ 732 | \$ 732 | 0,02 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre | Long | 03/2024 | 70 | \$ (325) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin | Long | 09/2024 | 1 833 | 2 953 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre | Court | 12/2024 | 1 833 | (3 511) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 385 | 1 155 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars | Court | 03/2024 | 1 490 | (3 246) | (0,07) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 1 425 | (6 841) | (0,16) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 79 | (663) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 976 | 1 773 | 0,04 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 1 109 | 2 920 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 83 | 342 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 2 014 | (10 409) | (0,24) |
| | | | | \$ (15 852) | (0,36) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (15 852) | (0,36) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/06/2024 | \$ 12 400 | \$ 39 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2025 | 4 600 | 132 | 0,01 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2027 | 4 600 | 290 | 0,01 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/06/2028 | € 6 500 | 82 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2024 | \$ 4 700 | 28 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2024 | 5 500 | 127 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/06/2025 | € 14 500 | 2 720 | 0,06 |
| T-Mobile USA, Inc. | 5,000 | 20/06/2028 | \$ 6 700 | 64 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | 8 000 | 22 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2027 | 500 | 12 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 5 000 | 59 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 1 200 | 17 | 0,00 |
| | | | | \$ 3 592 | 0,08 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽²⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à payer | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽³⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|-------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-35 Index à 5 ans | (5,000) % | 20/12/2025 | \$ 9 312 | \$ 126 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-36 Index à 5 ans | (5,000) | 20/06/2026 | 5 238 | 160 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-38 Index à 5 ans | (5,000) | 20/06/2027 | 96 127 | (9 030) | (0,20) |
| | | | | \$ (8 744) | (0,20) |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 0,900 % | 15/03/2052 | £ 8 400 | \$ 4 281 | 0,10 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 4 900 | (816) | (0,02) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,320 | 20/10/2033 | 1 700 | 190 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 23 600 | (2 414) | (0,06) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,062 | 18/09/2026 | ¥ 3 550 000 | (275) | (0,01) |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,063 | 19/09/2026 | 7 000 | (1) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,064 | 19/09/2026 | 877 000 | (69) | 0,00 |
| À payer | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,380 | 18/06/2028 | 5 170 000 | (407) | (0,01) |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,500 % | 15/03/2042 | ¥ 2 698 500 | \$ 1 519 | 0,03 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,662 | 19/04/2042 | 260 000 | 174 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,705 | 31/10/2038 | 1 180 000 | 443 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 20/03/2038 | 436 000 | 104 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,750 | 20/12/2038 | 1 947 000 | 750 | 0,02 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,785 | 12/11/2038 | 600 000 | 216 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,800 | 22/10/2038 | 400 000 | 137 | 0,00 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,800 | 15/06/2052 | 4 070 000 | 4 118 | 0,09 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,730 | 24/02/2032 | \$ 14 800 | (2 203) | (0,05) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 21/12/2052 | 60 600 | 4 856 | 0,11 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,765 | 16/03/2032 | 45 000 | (6 487) | (0,15) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,943 | 21/04/2032 | 14 800 | (1 871) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,680 | 11/07/2032 | 31 600 | (1 796) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,690 | 11/07/2032 | 31 600 | (1 765) | (0,04) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 08/09/2029 | 6 800 | (166) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,050 | 14/12/2052 | 9 570 | 555 | 0,01 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,156 | 10/03/2033 | 21 900 | 165 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,300 | 06/03/2033 | 5 100 | (132) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,340 | 23/02/2030 | 7 100 | (151) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,370 | 01/03/2033 | 6 100 | (115) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,400 | 23/02/2033 | 4 100 | (68) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,405 | 01/03/2033 | 4 800 | (77) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,425 | 01/03/2033 | 4 800 | (71) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,430 | 27/02/2033 | 6 300 | (90) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,450 | 07/03/2033 | 9 400 | (119) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,470 | 22/02/2030 | 8 600 | (111) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/09/2025 | 122 300 | (519) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,525 | 02/03/2030 | 3 300 | (33) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,650 | 05/12/2024 | 68 600 | (618) | (0,01) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | 1 800 | (25) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 21/06/2025 | 196 100 | 138 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 1 900 | (37) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,800 | 22/08/2030 | 1 900 | 30 | 0,00 |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 1 900 | (47) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,842 | 26/12/2033 | 2 100 | (56) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 3 700 | (104) | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,900 | 30/08/2033 | 4 200 | 141 | 0,00 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 13/09/2033 | 7 600 | 294 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,950 | 19/12/2033 | 3 800 | (136) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,030 | 15/12/2033 | 4 100 | (173) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,600 | 17/07/2025 | 28 800 | 11 | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 5,388 | 18/10/2024 | 76 500 | (247) | (0,01) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,500 | 01/06/2032 | CAD 35 400 | (832) | (0,02) |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/09/2025 | 191 700 | 1 859 | 0,04 |
| À recevoir | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2033 | 12 000 | (469) | (0,01) |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,000 | 21/06/2025 | 298 000 | 2 813 | 0,06 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,750 | 14/07/2025 | 64 000 | 381 | 0,01 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 4,820 | 13/07/2025 | 25 600 | 179 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 3,750 | 15/06/2027 | NZD 39 100 | 90 | 0,00 |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 4,000 | 14/06/2024 | 115 900 | (190) | (0,01) |
| À payer | BBR NZD à 3 mois | 4,250 | 21/12/2027 | 3 300 | 3 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | AUD 10 900 | 348 | 0,01 |
| À payer ⁽⁴⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | 12 000 | 554 | 0,01 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,550 | 10/08/2024 | € 4 000 | (133) | 0,00 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,650 | 12/04/2027 | 25 000 | (1 616) | (0,04) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,000 | 13/05/2027 | 21 000 | (1 042) | (0,02) |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 1,580 | 24/05/2024 | 239 500 | (886) | (0,02) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 35 000 | (5 442) | (0,12) |
| À recevoir ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 3 100 | (46) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 4 600 | (93) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 3 500 | (119) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 2 200 | (81) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 5 100 | (111) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 2 800 | (69) | 0,00 |
| À payer ⁽⁴⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 94 700 | 7 222 | 0,16 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 2 300 | (115) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,128 | 04/12/2033 | 1 800 | (100) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 2 900 | (166) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 2 300 | (78) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 1 900 | (71) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 1 400 | (98) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 2 700 | (196) | (0,01) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,865 | 24/11/2028 | MXN 43 600 | 29 | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,945 | 22/11/2028 | 121 000 | 103 | 0,00 |
| | | | | | \$ (1 449) | (0,03) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (6 601) | (0,15) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

- (2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.
- (3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.
- (4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| GLM | Option de vente - GBP contre USD hors cote | \$ 1,200 | 26/09/2024 | 11 100 | \$ 367 | \$ 117 | 0,00 |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BPS | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 5,050 % | 28/05/2024 | 55 200 | \$ 63 | \$ 17 | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,433 | 06/02/2024 | 23 200 | 123 | 222 | 0,01 |
| FAR | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,600 | 13/12/2024 | 29 100 | 330 | 202 | 0,00 |
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,975 | 29/05/2024 | 55 200 | 61 | 21 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,443 | 06/02/2024 | 23 300 | 124 | 230 | 0,01 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,636 | 07/10/2024 | 39 000 | 702 | 1 782 | 0,04 |
| | | | | | | | \$ 1 403 | \$ 2 474 | 0,06 |

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| GLM | Option de vente - GBP contre USD hors cote | \$1,100 | 26/09/2024 | 22 200 | \$ (228) | \$ (50) | 0,00 |

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 1 200 | \$ (5) | \$ (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 1 200 | (5) | (2) | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 28/05/2024 | 27 600 | (63) | (124) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 1 900 | (9) | (14) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 3 800 | (17) | (48) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 1 900 | (9) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 3 800 | (17) | (1) | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 3 800 | (16) | (12) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 3 800 | (16) | (11) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 1 700 | (7) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 2 600 | (10) | (29) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 1 700 | (7) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 2 600 | (10) | 0 | 0,00 |
| FAR | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,273 | 16/01/2024 | 2 100 | (9) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,489 | 08/01/2024 | 2 100 | (10) | (15) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,550 | 16/01/2024 | 2 100 | (9) | (27) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,723 | 16/01/2024 | 2 100 | (9) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,989 | 08/01/2024 | 2 100 | (10) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,000 | 16/01/2024 | 2 100 | (9) | (1) | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,195 | 29/05/2024 | 27 600 | (61) | (102) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 3 700 | (15) | (11) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 1 800 | (7) | (7) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 3 800 | (16) | (13) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 3 700 | (19) | (39) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 3 700 | (18) | (47) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 3 600 | (16) | (58) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 3 700 | (15) | (12) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 1 800 | (7) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 3 800 | (16) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 3 700 | (19) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 3 700 | (18) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 4 300 | (10) | (15) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 4 300 | (10) | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 2 000 | (9) | (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 2 000 | (8) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 18/01/2024 | 2 100 | (10) | (11) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 2 100 | (10) | (33) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 2 000 | (9) | (10) | 0,00 |

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 % | 22/01/2024 | 2 000 | \$ (8) | \$ (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 18/01/2024 | 2 100 | (10) | (4) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 2 100 | (10) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 2 700 | (11) | (21) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 3 600 | (13) | (57) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 2 700 | (11) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 3 600 | (13) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 3 900 | (19) | (22) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 1 900 | (9) | (12) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 2 000 | (9) | (32) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 3 900 | (18) | (70) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 3 900 | (19) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 1 900 | (9) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 2 000 | (9) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 3 900 | (18) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 2 700 | (11) | (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 2 700 | (11) | (5) | 0,00 |
| UAG | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,344 | 18/01/2024 | 2 000 | (10) | (10) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,744 | 18/01/2024 | 2 000 | (10) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (768) | \$ (940) | (0,02) |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-----------------|-------------------|----------------------------------|----------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % éch. 01/02/2054 | \$ 101,094 | 06/02/2024 | 4 400 | \$ (17) | \$ (36) | 0,00 |
| SAL | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/01/2054 | 99,906 | 09/01/2024 | 3 300 | (8) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/02/2054 | 99,070 | 06/02/2024 | 60 700 | (247) | (452) | (0,01) |
| | | | | | \$ (272) | \$ (490) | (0,01) |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(recues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BPS | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 % | 20/06/2027 | \$ 1 600 | \$ (77) | \$ 78 | \$ 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 400 | (36) | 34 | (2) | 0,00 |
| BRC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2026 | 2 325 | (107) | 123 | 16 | 0,00 |
| CBK | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 700 | (25) | 26 | 1 | 0,00 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 3 000 | (112) | 114 | 2 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 1 300 | (116) | 109 | (7) | 0,00 |
| JPM | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2026 | 2 275 | (104) | 119 | 15 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 400 | (15) | 15 | 0 | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/06/2027 | 2 900 | (104) | 106 | 2 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement colombien | 1,000 | 20/12/2027 | 3 400 | (303) | 285 | (18) | 0,00 |
| | | | | | \$ (999) | \$ 1 009 | \$ 10 | 0,00 |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 23 372 | AUD 35 282 | \$ 709 | \$ 0 | \$ 709 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH 35 832 | \$ 4 971 | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | £ 9 380 | 11 914 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 01/2024 | NZD 3 765 | 2 294 | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 050 | £ 830 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 144 | ¥ 463 938 | 149 | 0 | 149 | 0,00 |
| | 01/2024 | 101 | MXN 1 723 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 50 433 | \$ 6 963 | 0 | (160) | (160) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR 17 657 165 | 1 123 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 122 | IDR 1 900 838 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 4 272 | INR 357 498 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 972 012 | \$ 747 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 766 008 | 843 005 | 0 | (3 361) | (3 361) | (0,08) |
| | 01/2024 | £ 35 980 | 45 636 | 0 | (233) | (233) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 15 174 | 43 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW 328 445 | 250 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 8 068 | 440 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 16 138 | BRL 78 972 | 119 | 0 | 119 | 0,00 |
| | 01/2024 | 9 311 | CAD 12 645 | 280 | 0 | 280 | 0,01 |

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|---------|--------|
| | 01/2024 | \$ | 1 334 | € | 1 219 | \$ 13 | \$ 0 | \$ 13 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 | HUF | 700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 550 | IDR | 8 506 948 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 4 | SGD | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 12 516 | ZAR | 232 028 | 155 | 0 | 155 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 317 548 | \$ | 9 975 | 0 | (520) | (520) | (0,01) |
| | 03/2024 | CNH | 34 902 | | 4 850 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 319 | | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 53 | CNH | 380 | 1 | (9) | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 1 916 | IDR | 29 408 408 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 14 846 | INR | 1 241 756 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 3 443 | TWD | 108 466 | 151 | 0 | 151 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 4 109 207 | \$ | 3 145 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | | 710 765 | | 550 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 4 623 | | 262 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 1 036 | CLP | 896 903 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 648 | € | 1 507 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 566 | TRY | 46 565 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 496 | ZAR | 9 243 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 469 | TRY | 14 296 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 400 | IDR | 6 215 333 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 9 | THB | 296 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 5 773 | TRY | 182 349 | 36 | (26) | 10 | 0,00 |
| | 04/2024 | | 7 724 | | 248 597 | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| CBK | 06/2024 | KRW | 4 235 523 | \$ | 3 245 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | 01/2024 | BRL | 65 614 | | 13 476 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD | 349 | | 257 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 1 994 | | 2 526 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 1 261 771 | | 3 603 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | 01/2024 | IDR | 7 714 269 | | 501 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 219 721 | | 12 482 | 0 | (434) | (434) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ | 1 341 | € | 1 243 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 2 913 | £ | 2 302 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 1 180 | MXN | 21 671 | 94 | 0 | 94 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 24 | TRY | 703 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 10 073 | \$ | 534 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 5 356 | BRL | 27 102 | 214 | 0 | 214 | 0,00 |
| | 03/2024 | PEN | 20 271 | \$ | 5 383 | 0 | (79) | (79) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 501 | IDR | 7 716 248 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 248 | ILS | 902 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 04/2024 | | 13 476 | BRL | 66 278 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | CAD | 193 | \$ | 142 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | KRW | 389 910 | | 300 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 24 002 | | 3 331 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 03/2024 | SGD | 22 042 | | 16 652 | 0 | (117) | (117) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 196 | IDR | 3 064 741 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW | 4 578 969 | \$ | 3 518 | 0 | (47) | (47) | 0,00 |
| FAR | 01/2024 | BRL | 15 408 | | 3 161 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 04/2024 | \$ | 3 161 | BRL | 15 566 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD | 105 017 | \$ | 77 278 | 0 | (2 375) | (2 375) | (0,05) |
| | 01/2024 | CHF | 387 | | 442 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 397 000 | | 2 708 | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN | 37 123 | | 2 116 | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 416 | BRL | 2 034 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | | 6 867 | MXN | 119 084 | 133 | 0 | 133 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR | 5 698 | \$ | 299 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 24 | TRY | 727 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 15 606 | \$ | 2 163 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 3 966 | IDR | 61 073 918 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | | 678 | TRY | 21 318 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | HUF | 2 025 125 | \$ | 5 785 | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 600 | IDR | 9 232 200 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | | 251 | KRW | 324 038 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | TWD | 33 785 | \$ | 1 055 | 0 | (62) | (62) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ | 3 990 | BRL | 19 570 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 02/2024 | | 2 084 | TRY | 63 616 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR | 53 871 800 | \$ | 3 475 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD | 626 768 | | 20 159 | 0 | (609) | (609) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ | 4 254 | IDR | 65 683 759 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 4 452 | INR | 372 188 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 03/2024 | | 56 | SGD | 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 06/2024 | KRW | 4 411 528 | \$ | 3 404 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 32 348 | | 35 227 | 0 | (514) | (514) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ | 714 | | 901 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ | 387 700 | | 2 712 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ | 9 529 | AUD | 14 371 | 279 | 0 | 279 | 0,01 |
| | 01/2024 | | 2 064 | CAD | 2 793 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH | 366 | \$ | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ | 5 190 | IDR | 80 003 935 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | CAD | 324 | \$ | 242 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | € | 275 | | 305 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ | 69 | | 88 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF | 80 222 | | 228 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | SGD 157 | \$ 119 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 250 | € 225 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 144 | £ 113 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 195 | ¥ 176 234 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 01/2024 | 152 | ZAR 2 797 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 34 193 | \$ 4 741 | 0 | (88) | (88) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 58 985 403 | \$ 3 832 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 2 906 | IDR 44 777 289 | 4 | (6) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 2 986 | TRY 93 223 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| RBC | 06/2024 | KRW 2 675 721 | \$ 2 057 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 840 | MXN 117 338 | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| SCX | 04/2024 | MXN 54 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 21 | € 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 061 | ¥ 152 500 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 33 569 | \$ 4 637 | 0 | (105) | (105) | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 18 049 | \$ 2 315 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 8 618 561 | \$ 549 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 1 402 | IDR 21 836 187 | 17 | (3) | 14 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 9 689 | INR 810 300 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 19 764 | THB 683 133 | 384 | 0 | 384 | 0,01 |
| | 03/2024 | \$ 1 865 | TWD 58 883 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 2 184 243 | \$ 1 683 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| SOG | 03/2024 | CZK 4 799 | \$ 213 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | \$ 1 976 | ¥ 289 818 | 81 | 0 | 81 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 16 235 | \$ 2 249 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 7 818 923 | \$ 496 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | CAD 10 827 | \$ 7 982 | 0 | (230) | (230) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 194 303 | \$ 245 895 | 0 | (1 811) | (1 811) | (0,04) |
| | 01/2024 | MXN 34 767 | \$ 1 964 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 7 708 | AUD 11 617 | 221 | 0 | 221 | 0,01 |
| | 01/2024 | \$ 2 924 | ZAR 55 824 | 124 | 0 | 124 | 0,00 |
| | | | | \$ 3 716 | \$ (12 266) | \$ (8 550) | (0,20) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | \$ 2 666 | CAD 3 625 | \$ 84 | \$ 0 | \$ 84 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | CAD 82 | \$ 62 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 972 | CAD 4 039 | 91 | 0 | 91 | 0,01 |
| MBC | 01/2024 | 414 | 560 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | CAD 82 | \$ 62 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 319 | CAD 420 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 2 994 | 4 061 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | | | | \$ 272 | \$ 0 | \$ 272 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Investisseurs en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | CHF 28 | \$ 33 | \$ 0 | \$ (1) | \$ (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 55 | CHF 47 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 1 049 | 914 | 38 | 0 | 38 | (0,01) |
| CBK | 01/2024 | CHF 395 | \$ 454 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 6 719 | CHF 5 853 | 238 | 0 | 238 | 0,01 |
| GLM | 01/2024 | 7 111 | 6 231 | 297 | 0 | 297 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 7 202 | 6 286 | 271 | 0 | 271 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | 30 | 26 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 846 | \$ (16) | \$ 830 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de capitalisation et T en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 15 176 | \$ 16 607 | \$ 3 | \$ (165) | \$ (162) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 448 709 | € 408 086 | 2 187 | 0 | 2 187 | 0,05 |
| BRC | 01/2024 | 391 980 | 356 417 | 1 826 | 0 | 1 826 | 0,04 |
| CBK | 01/2024 | € 3 519 | \$ 3 824 | 0 | (64) | (64) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 562 | € 521 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 2 138 | \$ 2 333 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 354 939 | € 324 618 | 3 733 | 0 | 3 733 | 0,08 |
| | | | | \$ 7 763 | \$ (259) | \$ 7 504 | 0,17 |

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 1 840 | £ 1 452 | \$ 11 | \$ 0 | \$ 11 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 0 | \$ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 847 | £ 1 456 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | £ 29 | \$ 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 14 | \$ 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 3 316 | £ 2 620 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | £ 13 | \$ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 103 | \$ 131 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 62 | £ 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 18 | \$ 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 41 | £ 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 10 105 | 7 989 | 80 | 0 | 80 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | 6 346 | 5 029 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 10 104 | 7 984 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| | | | | \$ 264 | \$ 0 | \$ 264 | 0,01 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation, Administrations en SGD (couverte) de distribution et E en SGD (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| DUB | 01/2024 | \$ 9 112 | SGD 12 113 | \$ 73 | \$ 0 | \$ 73 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | SGD 77 | \$ 57 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 81 | SGD 108 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | 2 190 | 2 921 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | SGD 202 | \$ 152 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 891 | SGD 2 519 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 02/2024 | SGD 15 | \$ 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 283 | SGD 373 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 8 294 | 11 063 | 96 | 0 | 96 | 0,01 |
| | 02/2024 | 15 | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | 7 332 | 9 782 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 641 | 852 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | | | | \$ 306 | \$ (2) | \$ 304 | 0,01 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 1 745 0,04

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------|----------------------------|---------------------|
| NCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| 2,000 % éch. 01/01/2054 | \$ 32 300 | \$ (26 405) | (0,60) |
| 2,000 % éch. 01/02/2054 | 9 600 | (7 857) | (0,18) |
| Total des Titres vendus à découvert | | \$ (34 262) | (0,78) |
| Total des Investissements | | \$ 6 006 132 | 135,88 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | \$ (1 586 081) | (35,88) |
| Actifs nets | | \$ 4 420 051 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 3 484 \$ (31 décembre 2022 : 1 858 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 25 953 \$) ont été nantis en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 35 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 53 307 \$ (31 décembre 2022 : 94 783 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 9 980 \$ (31 décembre 2022 : 13 885 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 5 907 673 | \$ 1 316 | \$ 5 908 989 |
| Fonds d'investissement | 151 381 | 0 | 0 | 151 381 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 732 | 0 | 732 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (9 595) | (11 113) | 0 | (20 708) |
| Titres vendus à découvert | 0 | (34 262) | 0 | (34 262) |
| Totaux | \$ 141 786 | \$ 5 863 030 | \$ 1 316 | \$ 6 006 132 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 4 765 456 | \$ 5 405 | \$ 4 770 861 |
| Fonds d'investissement | 292 421 | 0 | 0 | 292 421 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 170 895 | 0 | 170 895 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 39 217 | (35 072) | 0 | 4 145 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (68 457) | 0 | (68 457) |
| Totaux | \$ 331 638 | \$ 4 832 822 | \$ 5 405 | \$ 5 169 865 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------------|------------------|--|---------------------|
| BRC | 2,500 % | 20/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | € (464) | \$ (517) | (0,01) |
| | 3,350 | 20/09/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 283) | (1 430) | (0,03) |
| MBC | 3,400 | 15/08/2023 | À définir ⁽¹⁾ | (1 161) | (1 299) | (0,03) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (3 246) | (0,07) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 619 | \$ (660) | \$ (41) | \$ (27) | \$ 0 | \$ (27) |
| BOA | (190) | 260 | 70 | (167) | 280 | 113 |
| BPS | (1 685) | 4 030 | 2 345 | 1 927 | (1 740) | 187 |
| BRC | 1 815 | (3 920) | (2 105) | (182) | 20 | (162) |
| CBK | 152 | 0 | 152 | 8 777 | (8 710) | 67 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | 4 | 0 | 4 |
| DUB | (152) | 0 | (152) | 374 | (270) | 104 |
| FAR | 155 | 0 | 155 | 1 | 0 | 1 |
| GLM | (2 320) | 2 510 | 190 | (710) | 600 | (110) |
| GST | (20) | 260 | 240 | (273) | 260 | (13) |
| JPM | (872) | 930 | 58 | (176) | 0 | (176) |
| MBC | 3 501 | (5 220) | (1 719) | 6 728 | (6 220) | 508 |
| MYC | 1 848 | (2 000) | (152) | (550) | 470 | (80) |
| MYI | 270 | (320) | (50) | (406) | 270 | (136) |
| RBC | 58 | 0 | 58 | (4) | 0 | (4) |
| RYL | S/O | S/O | S/O | 1 | 0 | 1 |
| SAL | (454) | 550 | 96 | (68) | 0 | (68) |
| SCX | 469 | (320) | 149 | (11 948) | 11 385 | (563) |
| SOG | (1) | 0 | (1) | (34) | 0 | (34) |
| SSB | 65 | 0 | 65 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | 112 | 0 | 112 | (2) | 600 | 598 |
| UAG | (1 625) | 1 440 | (185) | 62 | 0 | 62 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 57,73 | 66,92 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 75,96 | 47,33 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 0,68 |
| Fonds d'investissement | 3,42 | 7,05 |
| Contrats de mise en pension | 0,02 | 4,12 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,36) | 0,86 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,15) | (0,84) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,04 | 0,08 |
| Titres vendus à découvert | (0,78) | (1,65) |
| Contrats de prise en pension | (0,07) | (0,04) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | S/O | (1,85) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 40,66 | 36,37 |
| Obligations et billets municipaux | 0,40 | 0,28 |
| Agences du gouvernement américain | 53,46 | 37,34 |
| Obligations du Trésor américain | 18,14 | 17,09 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 8,52 | 9,41 |
| Titres adossés à des actifs | 7,73 | 9,66 |
| Émissions souveraines | 4,28 | 2,46 |
| Instruments à court terme | 0,50 | 2,32 |
| Fonds d'investissement | 3,42 | 7,05 |
| Contrats de mise en pension | 0,02 | 4,12 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,36) | 0,87 |
| Options vendues | | |
| Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse | S/O | (0,01) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection | S/O | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,08 | 0,07 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,20) | (0,12) |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,03) | (0,79) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Options de change | 0,00 | S/O |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,06 | 0,07 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Options de change | 0,00 | S/O |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (0,11) |
| Options sur titres | (0,01) | 0,00 |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,00 | (0,03) |
| Contrats de change à terme | (0,20) | (0,57) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,21 | 0,72 |
| Titres vendus à découvert | (0,78) | (1,65) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (35,88) | (24,55) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETTS PRIVÉS | | | | | | | | | | | |
| BANQUE ET FINANCE | | | | | | | | | | | |
| AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % éch. 14/08/2024 | \$ 1 000 | \$ 981 | 0,41 | Lloyds Banking Group PLC 4,450 % éch. 08/05/2025 | 400 | 396 | 0,17 | Chugoku Electric Power Co., Inc. 2,401 % éch. 27/08/2024 | \$ 1 000 | \$ 978 | 0,41 |
| 3,150 % éch. 15/02/2024 | 1 550 | 1 544 | 0,64 | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,837 % éch. 17/04/2026 | 500 | 491 | 0,20 | Dominion Energy, Inc. 3,071 % éch. 15/08/2024 | 2 800 | 2 755 | 1,15 |
| Aozora Bank Ltd. 1,050 % éch. 09/09/2024 | 1 800 | 1 742 | 0,73 | 4,788 % éch. 18/07/2025 | 500 | 498 | 0,21 | DTE Energy Co. 4,220 % éch. 01/11/2024 | 2 000 | 1 978 | 0,82 |
| 5,900 % éch. 02/03/2026 | 2 000 | 2 021 | 0,84 | Nationwide Building Society 0,550 % éch. 22/01/2024 | 600 | 598 | 0,25 | Enel Finance International NV 2,650 % éch. 10/09/2024 | 2 800 | 2 735 | 1,14 |
| Aries Capital DAC 0,000 % éch. 18/09/2030 (a) | 14 885 | 15 638 | 6,51 | NatWest Markets PLC 3,479 % éch. 22/03/2025 | 342 | 335 | 0,14 | Mississippi Power Co. 5,736 % éch. 28/06/2024 | 275 | 275 | 0,11 |
| Athene Global Funding 0,950 % éch. 08/01/2024 | 2 500 | 2 498 | 1,04 | Nissan Motor Acceptance Co. LLC 1,050 % éch. 08/03/2024 | 400 | 396 | 0,17 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,940 % éch. 21/03/2024 | 300 | 298 | 0,12 |
| Banco Santander S.A. 3,892 % éch. 24/05/2024 | 1 200 | 1 192 | 0,50 | 6,282 % éch. 08/03/2024 | 700 | 700 | 0,29 | 6,449 % éch. 21/03/2024 | 500 | 500 | 0,21 |
| Bank of America Corp. 5,834 % éch. 14/06/2024 | 1 100 | 1 099 | 0,46 | Nomura Holdings, Inc. 2,648 % éch. 16/01/2025 | 3 800 | 3 689 | 1,54 | Pacific Gas & Electric Co. 3,400 % éch. 15/08/2024 | 2 000 | 1 967 | 0,82 |
| 6,053 % éch. 04/02/2025 | 1 000 | 999 | 0,42 | Pacific Life Global Funding 6,035 % éch. 04/06/2026 | 1 200 | 1 190 | 0,50 | Southern California Edison Co. 6,266 % éch. 01/04/2024 | 1 389 | 1 389 | 0,58 |
| Bank of Montreal 5,682 % éch. 09/07/2024 | 175 | 175 | 0,07 | Protective Life Global Funding 6,469 % éch. 11/12/2024 | 1 025 | 1 029 | 0,43 | Spire Missouri, Inc. 5,914 % éch. 02/12/2024 | 2 800 | 2 797 | 1,16 |
| Bank of Nova Scotia 5,767 % éch. 31/07/2024 | 123 | 123 | 0,05 | Public Storage Operating Co. 5,975 % éch. 25/07/2025 | 200 | 201 | 0,08 | Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd. 4,898 % éch. 23/08/2024 | AUD 500 | 340 | 0,14 |
| 6,378 % éch. 11/03/2024 | 500 | 500 | 0,21 | Royal Bank of Canada 5,701 % éch. 07/10/2024 | 215 | 215 | 0,09 | Vodafone Group PLC 6,645 % éch. 16/01/2024 | \$ 500 | 500 | 0,21 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 2,375 % éch. 21/11/2024 | 700 | 682 | 0,28 | Société Générale S.A. 3,875 % éch. 28/03/2024 | 2 000 | 1 991 | 0,83 | | | 17 107 | 7,12 |
| 5,792 % éch. 04/02/2025 | 1 000 | 995 | 0,41 | Standard Chartered PLC 0,991 % éch. 12/01/2025 | 500 | 499 | 0,21 | Total Obligations et billets privés | | 138 340 | 57,56 |
| 5,799 % éch. 04/02/2025 | 1 000 | 995 | 0,41 | 6,325 % éch. 23/11/2025 | 1 000 | 995 | 0,41 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Barclays PLC 3,932 % éch. 07/05/2025 | 600 | 596 | 0,25 | 6,337 % éch. 23/11/2025 | 200 | 199 | 0,08 | Federal Home Loan Bank 5,720 % éch. 27/09/2024 | 3 000 | 3 000 | 1,25 |
| BNP Paribas S.A. 3,800 % éch. 10/01/2024 | 2 833 | 2 832 | 1,18 | UBS AG 5,845 % éch. 09/08/2024 | 1 200 | 1 202 | 0,50 | Ginnie Mae 6,267 % éch. 20/08/2066 | 459 | 457 | 0,19 |
| 4,705 % éch. 10/01/2025 | 700 | 700 | 0,29 | Wells Fargo & Co. 2,406 % éch. 30/10/2025 | 3 000 | 2 919 | 1,21 | 6,288 % éch. 20/10/2073 | 2 011 | 2 007 | 0,83 |
| BPCE S.A. 4,000 % éch. 15/04/2024 | 1 000 | 996 | 0,41 | | | 94 110 | 39,16 | 6,391 % éch. 20/09/2066 | 469 | 481 | 0,20 |
| Capital One Financial Corp. 6,746 % éch. 09/05/2025 | 2 400 | 2 399 | 1,00 | INDUSTRIE | | | | Ginnie Mae, TBA 6,000 % éch. 01/01/2054 | 17 000 | 17 285 | 7,19 |
| CK Hutchison International Ltd. 3,250 % éch. 11/04/2024 | 1 000 | 995 | 0,41 | Arrow Electronics, Inc. 3,250 % éch. 08/09/2024 | 1 800 | 1 768 | 0,74 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| CNH Industrial Capital LLC 4,200 % éch. 15/01/2024 | 1 000 | 999 | 0,42 | Ausgrid Finance Pty. Ltd. 3,750 % éch. 30/10/2024 | AUD 1 000 | 675 | 0,28 | 5,000 % éch. 01/01/2039 | 4 000 | 4 025 | 1,67 |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,567 % éch. 19/04/2024 | AUD 500 | 341 | 0,14 | Baxter International, Inc. 1,322 % éch. 29/11/2024 | \$ 1 800 | 1 734 | 0,72 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 4 300 | 4 320 | 1,80 |
| Crédit Agricole S.A. 3,250 % éch. 04/10/2024 | \$ 400 | 393 | 0,16 | 5,853 % éch. 29/11/2024 | 200 | 200 | 0,08 | 6,000 % éch. 01/02/2054 | 4 300 | 4 366 | 1,82 |
| Credit Suisse AG 3,625 % éch. 09/09/2024 | 1 200 | 1 184 | 0,49 | Boeing Co. 1,433 % éch. 04/02/2024 | 2 700 | 2 689 | 1,12 | | | 35 941 | 14,95 |
| 4,750 % éch. 09/08/2024 | 200 | 199 | 0,08 | Broadcom Corp. 3,625 % éch. 15/01/2024 | 499 | 499 | 0,21 | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Crown Castle, Inc. 3,200 % éch. 01/09/2024 | 1 200 | 1 181 | 0,49 | Charter Communications Operating LLC 4,500 % éch. 01/02/2024 | 1 000 | 998 | 0,41 | Dilosk RMBS DAC 4,752 % éch. 20/02/2060 | € 265 | 293 | 0,12 |
| Danske Bank A/S 5,375 % éch. 12/01/2024 | 2 000 | 2 000 | 0,83 | 7,289 % éch. 01/02/2024 | 1 700 | 1 700 | 0,71 | Sage AR Funding PLC 6,471 % éch. 17/11/2030 | £ 200 | 253 | 0,11 |
| Deutsche Bank AG 0,898 % éch. 28/05/2024 (d) | 2 500 | 2 456 | 1,02 | Dell International LLC 4,000 % éch. 15/07/2024 | 355 | 352 | 0,15 | Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | 143 | 182 | 0,08 |
| DNB Bank ASA 0,856 % éch. 30/09/2025 | 3 000 | 2 898 | 1,21 | Enbridge, Inc. 6,031 % éch. 16/02/2024 | 215 | 215 | 0,09 | Towd Point Mortgage Trust 5,755 % éch. 25/02/2057 | \$ 59 | 60 | 0,02 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 5,483 % éch. 18/02/2025 | AUD 500 | 341 | 0,14 | Energy Transfer LP 3,900 % éch. 15/05/2024 | 2 000 | 1 985 | 0,83 | Trinity Square PLC 6,070 % éch. 15/07/2059 | £ 113 | 144 | 0,06 |
| GA Global Funding Trust 6,727 % éch. 11/04/2025 | \$ 700 | 699 | 0,29 | 4,500 % éch. 15/04/2024 | 1 500 | 1 495 | 0,62 | Tudor Rose Mortgages 5,820 % éch. 20/06/2048 | 206 | 261 | 0,11 |
| General Motors Financial Co., Inc. 3,950 % éch. 13/04/2024 | 1 500 | 1 491 | 0,62 | Haleon U.S. Capital LLC 3,024 % éch. 24/03/2024 | 1 000 | 994 | 0,41 | | | 1 193 | 0,50 |
| 6,177 % éch. 08/03/2024 | 899 | 899 | 0,37 | Hyundai Capital America 0,800 % éch. 08/01/2024 | 2 000 | 1 999 | 0,83 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | |
| Goldman Sachs Group, Inc. 5,900 % éch. 02/05/2024 | AUD 1 300 | 888 | 0,37 | Mitsubishi Corp. 3,375 % éch. 23/07/2024 | 1 569 | 1 550 | 0,64 | Carlyle Euro CLO DAC 4,892 % éch. 15/08/2032 | € 300 | 327 | 0,14 |
| Greenleaves Capital Designated Activity Co. 0,000 % éch. 18/09/2030 (a) | \$ 14 885 | 15 638 | 6,51 | NetApp, Inc. 3,300 % éch. 29/09/2024 | 2 800 | 2 753 | 1,15 | Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,795 % éch. 15/07/2031 | \$ 5 880 | 5 873 | 2,44 |
| HSBC Holdings PLC 3,803 % éch. 11/03/2025 | 1 200 | 1 195 | 0,50 | Penske Truck Leasing Co. LP 3,900 % éch. 01/02/2024 | 3 000 | 2 994 | 1,25 | CBAM Ltd. 6,797 % éch. 20/10/2029 | 379 | 379 | 0,16 |
| 6,863 % éch. 11/03/2025 | 800 | 801 | 0,33 | Siemens Financieringsmaatschappij NV 5,848 % éch. 11/03/2024 | 1 527 | 1 527 | 0,63 | EFS Volunteer LLC 6,446 % éch. 25/10/2035 | 35 | 35 | 0,01 |
| ING Bank Australia Ltd. 4,000 % éch. 26/05/2025 | AUD 1 600 | 1 083 | 0,45 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 4,150 % éch. 15/03/2024 | 1 000 | 996 | 0,41 | Elevation CLO Ltd. 6,885 % éch. 15/10/2029 | 323 | 323 | 0,13 |
| Jackson National Life Global Funding 6,586 % éch. 28/06/2024 | \$ 400 | 401 | 0,17 | | | 27 123 | 11,28 | Euro-Galaxy CLO DAC 4,589 % éch. 24/04/2034 | € 250 | 271 | 0,11 |
| JPMorgan Chase & Co. 0,969 % éch. 23/06/2025 | 1 000 | 977 | 0,41 | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | Greenwood Park CLO Ltd. 6,665 % éch. 15/04/2031 | \$ 1 577 | 1 578 | 0,66 |
| | | | | CenterPoint Energy, Inc. 6,046 % éch. 13/05/2024 | 595 | 595 | 0,25 | Harvest CLO DAC 4,566 % éch. 26/06/2030 | € 165 | 181 | 0,08 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|---|----------------------------------|-------------------------------|---------------------|--|---------|-------------------------------|---------------------|
| Madison Park Funding Ltd. 6,405 % éch. 15/04/2029 | \$ 186 | \$ 185 | 0,08 | PSP Capital, Inc. 5,652 % éch. 03/03/2025 | \$ 2 500 | \$ 2 499 | 1,04 | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| Magnétite Ltd. 6,777 % éch. 18/10/2031 | 2 400 | 2 401 | 1,00 | | | 4 533 | 1,89 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c) | 169 652 | \$ 1 691 | 0,71 |
| Nassau Ltd. 6,905 % éch. 15/01/2030 | 1 237 | 1 238 | 0,51 | INSTRUMENTS À COURT TERME | | | | FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE | | | |
| Oak Hill European Credit Partners DAC 4,733 % éch. 20/10/2031 | € 299 | 327 | 0,14 | BILLETTS DE TRÉSORERIE | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c) | 220 110 | 21 949 | 9,13 |
| SLM Private Credit Student Loan Trust 5,936 % éch. 15/06/2039 | \$ 335 | 323 | 0,13 | Marathon Oil Corp. 6,050 % éch. 03/01/2024 | 1 000 | 999 | 0,42 | | | | |
| | | 13 441 | 5,59 | VW Credit, Inc. 5,700 % éch. 04/01/2024 | 1 600 | 1 599 | 0,66 | | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | | | 2 598 | 1,08 | | | | |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 3,750 % éch. 31/03/2024 | ILS 100 | 28 | 0,01 | BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | | | | |
| Banque de développement coréenne 5,606 % éch. 09/03/2024 | \$ 2 000 | 2 006 | 0,84 | 10,900 % éch. 04/01/2024 (a)(b) | HUF 2 513 000 | 7 258 | 3,02 | | | | |
| | | | | Total des Instruments à court terme | | 9 856 | 4,10 | | | | |
| | | | | Total des Valeurs mobilières | | \$ 203 304 | 84,59 | | | | |
| | | | | | | | | Total des Fonds d'investissement | | \$ 23 640 | 9,84 |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|--------------------|--|--|---------------------|
| DEU | 5,420 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 17 200 | Obligations du Trésor américain 2,375 % échéance 15/11/2049 | \$ (17 608) | \$ 17 200 | \$ 17 210 | 0,08 |
| SSB | 2,600 | 29/12/2023 | 02/01/2024 | 1 266 | Billets du Trésor américain 0,250 % échéance 31/07/2025 | (1 291) | 1 266 | 1 266 | 0,53 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (18 899) | \$ 18 466 | \$ 18 476 | 7,68 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|---|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois décembre | Long | 12/2024 | 93 | \$ 184 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois juin | Long | 06/2024 | 28 | 39 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois juin | Long | 06/2025 | 64 | 30 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2025 | 228 | (485) | (0,20) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois juin | Long | 09/2024 | 117 | 232 | 0,10 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois mars | Court | 06/2024 | 20 | 32 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars | Long | 03/2024 | 146 | 46 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 98 | 166 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice BIST 30 Index février | Court | 02/2024 | 274 | (9) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index janvier | Long | 01/2024 | 28 | (13) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice DAX Index mars | Long | 03/2024 | 5 | (7) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini NASDAQ 100 Index mars | Long | 03/2024 | 17 | 197 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini Russell 2000 Index mars | Long | 03/2024 | 11 | 80 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars | Long | 03/2024 | 7 | 49 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX Bank mars | Long | 03/2024 | 591 | (40) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars | Long | 03/2024 | 186 | 319 | 0,13 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 5 | 21 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index mars | Long | 03/2024 | 27 | 60 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE China A50 Index janvier | Court | 01/2024 | 1 177 | (336) | (0,14) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE Taiwan Index janvier | Long | 01/2024 | 149 | 198 | 0,08 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/JSE Index mars | Court | 03/2024 | 127 | (141) | (0,06) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/MIB Index mars | Long | 03/2024 | 11 | (7) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Hang Seng China Enterprises Index janvier | Court | 01/2024 | 162 | (195) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice IBEX 35 Index janvier | Long | 01/2024 | 22 | (20) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice MSCI Singapore Index janvier | Court | 01/2024 | 113 | (115) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Nikkei 225 Index mars | Long | 03/2024 | 22 | 23 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index janvier | Long | 01/2024 | 210 | 90 | 0,04 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P CNX Nifty Index janvier | Long | 01/2024 | 167 | 108 | 0,04 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice S&P/Toronto Stock Exchange 60 Index mars | Long | 03/2024 | 14 | 62 | 0,03 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index mars | Long | 03/2024 | 64 | 175 | 0,07 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Topix Index mars | Long | 03/2024 | 28 | 24 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 54 | 106 | 0,04 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 8 | 19 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 11 | (35) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur Indice Volatility S&P 500 Index janvier | Court | 01/2024 | 183 | 210 | 0,09 |
| Contrats à terme standardisés sur VSTOXX Mini janvier | Court | 01/2024 | 548 | 40 | 0,02 |
| Contrats à terme standardisés sur Indice WIG20 Index mars | Long | 03/2024 | 380 | 48 | 0,02 |
| | | | | \$ 1 155 | 0,48 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ 1 155 | 0,48 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.EM-39 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/06/2028 | \$ 9 500 | \$ 261 | 0,11 |
| Indice CDX.EM-40 Index à 5 ans | 1,000 | 20/12/2028 | 12 800 | 222 | 0,09 |
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | 4 158 | 113 | 0,05 |
| Indice iTraxx Crossover 40 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | € 2 900 | 142 | 0,06 |
| | | | | \$ 738 | 0,31 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 2 700 | \$ (516) | (0,21) |
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 29 200 | 1 525 | 0,63 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 37 200 | (343) | (0,14) |
| À payer ⁽³⁾ | MIBOR INR composé-OIS à 1 jour | 6,500 | 20/03/2029 | INR 2 454 500 | (10) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 21/03/2034 | ¥ 4 916 200 | 405 | 0,17 |
| À recevoir ⁽³⁾ | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 21/03/2054 | 591 300 | (235) | (0,10) |
| À payer ⁽³⁾ | SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour | 2,750 | 20/03/2029 | SGD 33 300 | 78 | 0,03 |
| À payer ⁽³⁾ | THORON THB composé-OIS à 1 jour | 2,500 | 20/03/2029 | THB 509 685 | (2) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,000 | 20/03/2054 | \$ 1 700 | (221) | (0,09) |
| À payer ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/03/2029 | 1 200 | 26 | 0,01 |
| À payer ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,250 | 20/03/2034 | 23 200 | 808 | 0,34 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/03/2026 | 72 500 | (713) | (0,30) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 5,342 | 02/01/2025 | BRL 14 100 | (209) | (0,09) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 5,585 | 02/01/2025 | 10 300 | (223) | (0,09) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 5,776 | 02/01/2025 | 3 300 | (77) | (0,03) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 5,846 | 02/01/2025 | 11 400 | (265) | (0,11) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 5,882 | 02/01/2025 | 3 000 | (66) | (0,03) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 6,626 | 02/01/2025 | 5 500 | 116 | 0,05 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 6,636 | 02/01/2025 | 4 900 | 104 | 0,04 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 6,847 | 02/01/2025 | 16 800 | 410 | 0,17 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 7,018 | 02/01/2025 | 7 900 | 185 | 0,08 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 7,335 | 02/01/2025 | 20 000 | 427 | 0,18 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 7,724 | 02/01/2025 | 7 800 | (161) | (0,07) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 7,741 | 02/01/2025 | 8 200 | 158 | 0,07 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 8,190 | 02/01/2025 | 14 600 | 264 | 0,11 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 8,557 | 02/01/2025 | 700 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 8,741 | 02/01/2025 | 21 700 | 329 | 0,14 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 8,996 | 02/01/2025 | 10 900 | 149 | 0,06 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 9,537 | 02/01/2025 | 13 300 | 144 | 0,06 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 9,642 | 02/01/2025 | 4 500 | 44 | 0,02 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 9,870 | 02/01/2029 | 8 100 | 2 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,038 | 02/01/2029 | 21 600 | 7 | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,276 | 02/01/2029 | 11 000 | (8) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,317 | 02/01/2029 | 9 500 | (28) | (0,01) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,321 | 04/01/2027 | 6 000 | (32) | (0,01) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,471 | 04/01/2027 | 20 100 | (62) | (0,03) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,512 | 02/01/2029 | 28 400 | (58) | (0,02) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,567 | 02/01/2029 | 23 700 | 79 | 0,03 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,583 | 02/01/2029 | 32 900 | (99) | (0,04) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,804 | 02/01/2029 | 30 000 | (133) | (0,06) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,827 | 02/01/2025 | 10 500 | (46) | (0,02) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 10,829 | 02/01/2029 | 12 900 | (61) | (0,03) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 10,933 | 02/01/2029 | 46 400 | 265 | 0,11 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,060 | 02/01/2029 | 18 700 | (117) | (0,05) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,071 | 04/01/2027 | 10 400 | (11) | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,099 | 04/01/2027 | 8 900 | 9 | 0,00 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,113 | 02/01/2029 | 15 500 | 63 | 0,03 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,140 | 02/01/2029 | 26 900 | 157 | 0,07 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,210 | 04/01/2027 | 17 900 | 31 | 0,01 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,272 | 04/01/2027 | 24 300 | 86 | 0,04 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,344 | 02/01/2029 | 22 800 | 162 | 0,07 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,383 | 04/01/2027 | 63 000 | 239 | 0,10 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,394 | 02/01/2029 | 24 000 | 177 | 0,07 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,459 | 04/01/2027 | 7 500 | 30 | 0,01 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,485 | 04/01/2027 | 37 800 | (180) | (0,08) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,540 | 04/01/2027 | 25 100 | 285 | 0,12 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,630 | 04/01/2027 | 28 200 | (159) | (0,07) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,660 | 04/01/2027 | 36 700 | (264) | (0,11) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,695 | 02/01/2029 | 500 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,696 | 04/01/2027 | 9 100 | (45) | (0,02) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,872 | 02/01/2029 | 63 300 | 649 | 0,27 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,920 | 02/01/2025 | 66 400 | 132 | 0,06 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,952 | 04/01/2027 | 28 000 | 195 | 0,08 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 11,975 | 02/01/2029 | 17 600 | 192 | 0,08 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 11,976 % | 04/01/2027 | BRL 21 800 | \$ (150) | (0,06) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,094 | 02/01/2029 | 89 700 | 1 041 | 0,43 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,115 | 04/01/2027 | 12 200 | 97 | 0,04 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,173 | 04/01/2027 | 6 000 | (48) | (0,02) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,226 | 02/01/2029 | 19 900 | 247 | 0,10 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,228 | 04/01/2027 | 25 200 | (238) | (0,10) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,299 | 04/01/2027 | 27 200 | 267 | 0,11 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,490 | 04/01/2027 | 7 900 | (79) | (0,03) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,492 | 02/01/2029 | 16 600 | 226 | 0,09 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,597 | 02/01/2029 | 36 400 | 534 | 0,22 |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,677 | 02/01/2029 | 34 000 | 514 | 0,21 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,753 | 04/01/2027 | 35 400 | (411) | (0,17) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 12,779 | 04/01/2027 | 45 700 | (555) | (0,23) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 12,806 | 04/01/2027 | 11 000 | 132 | 0,05 |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,073 | 04/01/2027 | 35 600 | (495) | (0,21) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,120 | 04/01/2027 | 47 200 | (661) | (0,27) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,207 | 04/01/2027 | 27 200 | (341) | (0,14) |
| À recevoir | CDI BRL à 1 an | 13,231 | 04/01/2027 | 34 700 | (506) | (0,21) |
| À payer | CDI BRL à 1 an | 13,318 | 04/01/2027 | 9 600 | 143 | 0,06 |
| À payer ⁽³⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 20/03/2029 | CAD 7 700 | 78 | 0,03 |
| À recevoir ⁽³⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 20/03/2034 | 16 300 | (765) | (0,32) |
| À payer ⁽³⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,250 | 20/03/2054 | 17 500 | 1 580 | 0,66 |
| À recevoir ⁽³⁾ | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/03/2026 | 38 500 | (176) | (0,07) |
| À payer ⁽³⁾ | CNREPOFIX CNY à 3 mois | 2,250 | 20/03/2029 | CNY 219 000 | 24 | 0,01 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 5,980 | 14/10/2026 | COP 4 816 400 | (81) | (0,03) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 6,950 | 04/02/2027 | 6 498 500 | 56 | 0,02 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,730 | 28/06/2028 | 15 146 400 | 14 | 0,01 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,830 | 13/12/2028 | 16 270 800 | 47 | 0,02 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,900 | 08/04/2027 | 4 251 300 | (9) | 0,00 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 7,960 | 01/09/2028 | 13 217 800 | (114) | (0,05) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,040 | 09/08/2028 | 30 999 700 | (128) | (0,05) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,070 | 14/11/2028 | 27 811 700 | 119 | 0,05 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,106 | 15/06/2028 | 22 329 600 | 104 | 0,04 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,128 | 10/11/2028 | 10 475 000 | 50 | 0,02 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,130 | 22/08/2028 | 6 457 600 | (9) | 0,00 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,188 | 15/11/2028 | 23 532 500 | 130 | 0,05 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,338 | 09/11/2028 | 15 447 500 | 106 | 0,04 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,494 | 27/05/2027 | 5 817 600 | (25) | (0,01) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,588 | 11/04/2028 | 27 727 300 | 189 | 0,08 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,700 | 10/04/2028 | 5 318 200 | 42 | 0,02 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,750 | 27/03/2028 | 21 497 700 | 221 | 0,09 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,830 | 28/04/2028 | 19 856 000 | (230) | (0,10) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,850 | 06/05/2027 | 6 000 000 | (38) | (0,02) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,970 | 05/08/2027 | 8 528 200 | 71 | 0,03 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,970 | 08/02/2028 | 9 288 600 | 98 | 0,04 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,990 | 08/02/2028 | 22 636 600 | 242 | 0,10 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 8,992 | 08/02/2028 | 23 240 200 | 249 | 0,10 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,020 | 24/03/2028 | 33 052 700 | 418 | 0,17 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,040 | 08/02/2028 | 4 678 200 | 52 | 0,02 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,140 | 07/02/2028 | 41 500 400 | 499 | 0,21 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,160 | 20/05/2027 | 8 106 600 | (75) | (0,03) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,190 | 13/10/2028 | 14 222 000 | (211) | (0,09) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,260 | 10/10/2028 | 5 040 000 | (78) | (0,03) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,370 | 02/10/2028 | 45 690 000 | (747) | (0,31) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 9,650 | 11/10/2028 | 20 400 000 | (400) | (0,17) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,050 | 09/09/2027 | 8 150 200 | (153) | (0,06) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,210 | 18/11/2027 | 3 214 900 | 66 | 0,03 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,240 | 24/02/2028 | 72 000 000 | (1 632) | (0,68) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,275 | 18/11/2027 | 6 380 400 | 135 | 0,06 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,390 | 30/09/2027 | 10 319 800 | (225) | (0,09) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,420 | 21/11/2027 | 6 380 400 | 144 | 0,06 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,430 | 21/11/2027 | 6 563 400 | 148 | 0,06 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,443 | 21/11/2027 | 19 784 200 | 450 | 0,19 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,478 | 29/09/2027 | 10 549 600 | (237) | (0,10) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,800 | 31/10/2027 | 32 387 900 | (1 051) | (0,44) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,810 | 14/10/2027 | 5 776 200 | (143) | (0,06) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,920 | 18/10/2027 | 2 950 700 | (76) | (0,03) |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 10,940 | 18/10/2027 | 5 920 600 | (154) | (0,06) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,424 | 21/10/2027 | 13 833 600 | 419 | 0,17 |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,450 | 21/10/2027 | 4 011 800 | 122 | 0,05 |
| À recevoir | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,800 | 24/10/2027 | 33 238 700 | (1 046) | (0,44) |
| À payer | IBR COP composé-OIS à 3 mois | 11,850 | 24/10/2027 | 1 323 300 | 45 | 0,02 |
| À payer ⁽³⁾ | HIBOR HKD à 3 mois | 3,500 | 20/03/2029 | HKD 60 231 | 44 | 0,02 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 0,520 | 26/07/2026 | ILS 24 300 | (521) | (0,22) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 0,601 | 05/07/2026 | 2 800 | 63 | 0,03 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 0,628 | 25/06/2026 | 5 600 | (100) | (0,04) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 0,692 | 13/09/2026 | 48 400 | 939 | 0,39 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 0,728 | 04/06/2026 | 4 100 | (77) | (0,03) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 0,730 | 21/05/2026 | 3 500 | 63 | 0,03 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 0,750 | 10/12/2026 | 34 100 | (721) | (0,30) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 0,900 | 07/10/2026 | 9 000 | (185) | (0,08) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 0,905 | 25/11/2026 | 8 100 | (176) | (0,07) |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 0,965 % | 14/01/2027 | ILS 10 600 | \$ 205 | 0,09 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 1,040 | 28/10/2026 | 10 400 | (210) | (0,09) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 1,049 | 12/11/2026 | 12 000 | 228 | 0,09 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 1,105 | 21/01/2027 | 16 900 | 300 | 0,12 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 1,178 | 04/02/2027 | 13 800 | 232 | 0,10 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 2,183 | 06/05/2027 | 7 500 | 57 | 0,02 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 2,390 | 27/05/2027 | 11 400 | 65 | 0,03 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 2,666 | 18/07/2027 | 7 500 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 2,670 | 15/07/2027 | 34 800 | (124) | (0,05) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 2,825 | 10/06/2027 | 10 900 | (13) | (0,01) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,210 | 17/06/2027 | 1 900 | 5 | 0,00 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,260 | 18/11/2027 | 38 400 | (69) | (0,03) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,290 | 16/11/2027 | 25 363 | (28) | (0,01) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,440 | 24/11/2028 | 65 100 | (39) | (0,02) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,460 | 23/11/2028 | 25 000 | 16 | 0,01 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,515 | 22/11/2028 | 23 200 | 31 | 0,01 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,530 | 03/04/2028 | 69 500 | 404 | 0,17 |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,590 | 31/03/2028 | 24 500 | 161 | 0,07 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,590 | 18/05/2028 | 14 100 | (93) | (0,04) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,619 | 05/01/2028 | 27 400 | (258) | (0,11) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,650 | 02/01/2028 | 18 900 | (185) | (0,08) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,670 | 30/12/2027 | 19 000 | (191) | (0,08) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,720 | 21/10/2027 | 72 900 | (190) | (0,08) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,770 | 18/10/2028 | 13 000 | 57 | 0,02 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,800 | 18/08/2028 | 20 200 | (218) | (0,09) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 3,915 | 19/10/2028 | 34 100 | 213 | 0,09 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 3,980 | 23/02/2028 | 8 600 | (126) | (0,05) |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 4,030 | 24/02/2028 | 54 700 | (974) | (0,41) |
| À payer | TELBOR ILS à 3 mois | 4,130 | 03/03/2028 | 30 000 | 374 | 0,16 |
| À recevoir | TELBOR ILS à 3 mois | 4,460 | 02/10/2028 | 39 300 | (501) | (0,21) |
| À payer ⁽³⁾ | KORIBOR KRW à 3 mois | 3,250 | 20/03/2029 | KRW 20 589 950 | 119 | 0,05 |
| À payer ⁽³⁾ | TAIBOR TWD à 3 mois | 1,500 | 20/03/2029 | TWD 171 850 | 3 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 4,900 | 12/11/2025 | ZAR 3 400 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 4,938 | 18/09/2025 | 7 000 | 23 | 0,01 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,120 | 02/09/2025 | 500 | 2 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,330 | 13/05/2025 | 8 300 | (35) | (0,01) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,375 | 27/05/2025 | 7 800 | (33) | (0,01) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,601 | 09/06/2026 | 31 050 | (83) | (0,03) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,680 | 08/06/2026 | 41 150 | (113) | (0,05) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,739 | 28/07/2026 | 72 100 | (200) | (0,08) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,780 | 03/03/2026 | 36 600 | 82 | 0,03 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,860 | 23/06/2026 | 75 600 | 174 | 0,07 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,950 | 17/03/2026 | 1 200 | 2 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 5,980 | 22/09/2026 | 43 900 | 104 | 0,04 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,023 | 01/07/2026 | 28 100 | 64 | 0,03 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,200 | 22/04/2025 | 7 800 | (45) | (0,02) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,231 | 29/09/2026 | 55 400 | 113 | 0,05 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,300 | 23/12/2026 | 30 900 | (65) | (0,03) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,320 | 23/04/2025 | 5 600 | (34) | (0,01) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,400 | 30/12/2026 | 33 600 | (75) | (0,03) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,540 | 04/01/2027 | 37 100 | (73) | (0,03) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,540 | 23/02/2027 | 64 600 | (127) | (0,05) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,670 | 12/01/2027 | 73 700 | 131 | 0,05 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,690 | 04/11/2026 | 2 000 | 4 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,835 | 28/08/2024 | 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 6,855 | 03/11/2026 | 22 830 | (31) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,049 | 09/03/2027 | 70 000 | 80 | 0,03 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,489 | 18/05/2027 | 112 100 | (17) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,600 | 19/06/2024 | 7 100 | 53 | 0,02 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,705 | 10/01/2028 | 504 000 | (211) | (0,09) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,710 | 06/05/2027 | 22 200 | 27 | 0,01 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,730 | 09/01/2028 | 119 300 | (35) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,740 | 17/08/2027 | 63 300 | (110) | (0,05) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,750 | 20/03/2024 | 9 180 | (68) | (0,03) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,900 | 06/01/2028 | 119 300 | 6 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,055 | 14/11/2027 | 8 400 | 10 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,064 | 27/07/2027 | 21 200 | (19) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,120 | 13/03/2028 | 99 500 | (119) | (0,05) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,205 | 17/02/2028 | 241 300 | (157) | (0,07) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,205 | 31/08/2028 | 89 600 | (156) | (0,06) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,220 | 30/08/2028 | 109 400 | 61 | 0,03 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,220 | 31/08/2028 | 30 900 | (57) | (0,02) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,250 | 22/11/2028 | 188 600 | 8 | 0,00 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,291 | 27/07/2028 | 47 900 | 35 | 0,01 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,305 | 27/07/2028 | 84 400 | 64 | 0,03 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,310 | 27/07/2028 | 47 900 | 37 | 0,02 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,330 | 27/07/2028 | 54 000 | 44 | 0,02 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,352 | 09/11/2028 | 248 400 | 127 | 0,05 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,355 | 03/11/2028 | 160 100 | 135 | 0,06 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,360 | 06/11/2028 | 104 400 | 83 | 0,03 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,370 | 20/07/2028 | 197 600 | 186 | 0,08 |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,411 | 19/07/2028 | 160 300 | 162 | 0,07 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,430 % | 23/02/2028 | ZAR 152 700 | \$ (167) | (0,07) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,465 | 23/02/2028 | 240 400 | (280) | (0,12) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,500 | 17/10/2027 | 12 000 | (17) | (0,01) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,510 | 25/04/2028 | 262 000 | (328) | (0,14) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,550 | 23/08/2028 | 137 100 | (175) | (0,07) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,560 | 25/04/2028 | 72 800 | 113 | 0,05 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,625 | 23/08/2028 | 115 300 | (166) | (0,07) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,700 | 22/08/2028 | 115 200 | (184) | (0,08) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 8,950 | 11/05/2028 | 67 000 | (188) | (0,08) |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,090 | 28/09/2028 | 64 300 | (127) | (0,05) |
| À payer | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,185 | 12/06/2028 | 150 700 | 250 | 0,10 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 9,350 | 18/05/2028 | 56 800 | (139) | (0,06) |
| À recevoir ⁽³⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,000 | 20/03/2026 | AUD 108 800 | (111) | (0,05) |
| À payer ⁽³⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | 23 900 | 121 | 0,05 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,649 | 20/12/2028 | CLP 4 292 400 | (11) | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 4,899 | 11/12/2028 | 8 430 700 | 67 | 0,03 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,009 | 12/12/2028 | 8 694 300 | 120 | 0,05 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,133 | 23/06/2028 | 3 579 500 | 72 | 0,03 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,158 | 15/06/2028 | 7 959 600 | 152 | 0,06 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,160 | 13/07/2028 | 6 791 900 | 0 | 0,00 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,230 | 14/06/2028 | 1 732 400 | 42 | 0,02 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,237 | 14/06/2028 | 2 356 600 | 55 | 0,02 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,261 | 17/11/2027 | 3 774 600 | 60 | 0,03 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,280 | 17/11/2027 | 3 854 600 | 61 | 0,03 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,290 | 13/06/2028 | 1 707 900 | 46 | 0,02 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,293 | 21/03/2028 | 4 537 600 | 55 | 0,02 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,300 | 17/11/2027 | 940 100 | 16 | 0,01 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,300 | 22/03/2028 | 5 848 400 | 68 | 0,03 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,358 | 18/11/2027 | 2 390 300 | 47 | 0,02 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,420 | 18/11/2027 | 7 201 400 | 161 | 0,07 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,455 | 16/08/2028 | 7 508 700 | (131) | (0,05) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,458 | 20/03/2028 | 7 549 300 | 142 | 0,06 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,475 | 13/11/2028 | 5 062 200 | 166 | 0,07 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,490 | 18/08/2028 | 2 882 200 | (57) | (0,02) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,530 | 18/11/2027 | 2 406 700 | 64 | 0,03 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,530 | 22/08/2028 | 2 959 500 | (67) | (0,03) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,540 | 17/08/2028 | 5 014 700 | (115) | (0,05) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,540 | 14/11/2028 | 5 093 400 | 120 | 0,05 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,550 | 17/08/2028 | 5 014 700 | (118) | (0,05) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,590 | 21/08/2028 | 5 749 900 | (146) | (0,06) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,631 | 23/08/2028 | 6 961 700 | (194) | (0,08) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,650 | 03/02/2028 | 5 748 800 | (115) | (0,05) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,650 | 01/06/2028 | 2 946 200 | (117) | (0,05) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,699 | 01/06/2028 | 4 644 000 | (198) | (0,08) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,750 | 28/09/2028 | 3 942 400 | 165 | 0,07 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,780 | 31/05/2028 | 1 398 200 | (67) | (0,03) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,798 | 31/05/2028 | 5 567 800 | (262) | (0,11) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 5,830 | 25/04/2028 | 5 063 700 | 187 | 0,08 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,000 | 16/02/2028 | 5 590 200 | (220) | (0,09) |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,207 | 31/05/2027 | 1 836 600 | 92 | 0,04 |
| À payer | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,230 | 27/05/2027 | 1 675 600 | 82 | 0,03 |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,370 | 03/03/2028 | 4 119 100 | (247) | (0,10) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,380 | 03/03/2028 | 4 366 200 | (261) | (0,11) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,385 | 07/03/2028 | 6 138 400 | (375) | (0,16) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,490 | 06/03/2028 | 8 848 600 | (577) | (0,24) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 6,885 | 13/05/2027 | 1 642 400 | (115) | (0,05) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,160 | 21/10/2027 | 5 870 000 | (508) | (0,21) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,161 | 17/06/2027 | 2 386 300 | (207) | (0,09) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,174 | 17/06/2027 | 1 432 400 | (127) | (0,05) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,420 | 09/09/2027 | 2 595 500 | (250) | (0,10) |
| À recevoir | CHILIBOR CLP à 6 mois | 7,900 | 30/09/2027 | 2 317 200 | (276) | (0,12) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 0,421 | 15/05/2025 | CZK 900 | (2) | 0,00 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 0,590 | 26/03/2025 | 10 900 | (26) | (0,01) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 0,637 | 24/07/2025 | 7 700 | (26) | (0,01) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 0,665 | 22/09/2025 | 5 100 | (15) | (0,01) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 0,690 | 04/05/2025 | 4 100 | (9) | 0,00 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 0,710 | 30/03/2025 | 100 | 0 | 0,00 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 0,776 | 20/08/2025 | 7 900 | (26) | (0,01) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,100 | 31/12/2025 | 57 000 | 170 | 0,07 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,124 | 13/03/2025 | 12 000 | (37) | (0,02) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,570 | 09/03/2026 | 59 800 | 171 | 0,07 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,580 | 19/03/2026 | 51 600 | 129 | 0,05 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,715 | 23/07/2026 | 100 200 | (350) | (0,15) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,775 | 04/06/2026 | 57 900 | (134) | (0,06) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,934 | 02/07/2026 | 95 200 | 323 | 0,13 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 1,972 | 07/07/2026 | 55 500 | 194 | 0,08 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 2,015 | 10/08/2026 | 132 200 | 364 | 0,15 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 3,340 | 06/01/2032 | 171 700 | (635) | (0,26) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 3,770 | 11/02/2027 | 72 000 | 13 | 0,01 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,020 | 22/11/2033 | 124 600 | 181 | 0,08 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,190 | 09/11/2028 | 240 400 | 142 | 0,06 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,195 | 21/03/2033 | 125 300 | 376 | 0,16 |

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,220 % | 21/03/2033 | CZK 67 600 | \$ 211 | 0,09 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,280 | 08/11/2033 | 124 900 | 282 | 0,12 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,300 | 18/03/2027 | 80 900 | (102) | (0,04) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,420 | 22/03/2028 | 172 600 | 349 | 0,15 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,420 | 05/05/2032 | 9 700 | 21 | 0,01 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,420 | 01/06/2033 | 82 200 | (322) | (0,13) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,440 | 12/12/2027 | 253 100 | 293 | 0,12 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,455 | 01/06/2033 | 29 100 | (124) | (0,05) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,510 | 22/03/2028 | 151 800 | 335 | 0,14 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,560 | 09/12/2027 | 156 700 | 211 | 0,09 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,615 | 11/07/2028 | 197 900 | (265) | (0,11) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,630 | 21/03/2028 | 151 800 | 373 | 0,16 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,638 | 03/10/2033 | 100 400 | (328) | (0,14) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,640 | 07/12/2027 | 156 700 | 229 | 0,10 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,680 | 08/12/2027 | 156 700 | 240 | 0,10 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,695 | 04/05/2028 | 116 300 | 327 | 0,14 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,730 | 03/10/2028 | 67 700 | (132) | (0,06) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 4,735 | 04/05/2028 | 95 500 | 276 | 0,12 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,070 | 20/04/2028 | 101 000 | (354) | (0,15) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,090 | 20/04/2028 | 121 900 | (432) | (0,18) |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,103 | 16/11/2027 | 240 300 | 514 | 0,21 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,140 | 11/07/2027 | 58 000 | 94 | 0,04 |
| À payer | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,175 | 11/07/2027 | 82 400 | 94 | 0,04 |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,175 | 23/02/2028 | 48 100 | (166) | (0,07) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,185 | 24/05/2027 | 64 000 | (195) | (0,08) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,215 | 24/02/2028 | 249 500 | (900) | (0,37) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,264 | 02/03/2028 | 224 100 | (890) | (0,37) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,285 | 20/05/2027 | 83 300 | (266) | (0,11) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,538 | 02/09/2027 | 52 400 | (133) | (0,06) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,640 | 10/06/2027 | 3 400 | (13) | (0,01) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,740 | 03/10/2027 | 121 600 | (366) | (0,15) |
| À recevoir | PRIBOR CZK à 6 mois | 5,788 | 20/10/2027 | 538 000 | (1 885) | (0,78) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | € 2 800 | (443) | (0,18) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 27 200 | 1 204 | 0,50 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 42 800 | (298) | (0,12) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 1,085 | 14/08/2025 | HUF 186 300 | 70 | 0,03 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 1,115 | 08/01/2026 | 1 131 600 | (487) | (0,20) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 1,220 | 15/01/2026 | 559 700 | 243 | 0,10 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 1,230 | 15/01/2026 | 872 700 | 380 | 0,16 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 1,920 | 16/04/2026 | 426 000 | (135) | (0,06) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 1,958 | 19/03/2026 | 1 746 000 | 560 | 0,23 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 1,980 | 09/03/2026 | 646 300 | 215 | 0,09 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 2,499 | 05/07/2026 | 78 800 | 33 | 0,01 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 2,558 | 06/08/2026 | 1 156 900 | 435 | 0,18 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 5,060 | 18/02/2027 | 885 100 | (95) | (0,04) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 5,500 | 04/03/2027 | 627 800 | 26 | 0,01 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 6,065 | 13/12/2028 | 963 600 | 31 | 0,01 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 6,100 | 11/03/2027 | 498 000 | (13) | (0,01) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 7,480 | 03/06/2027 | 700 700 | 243 | 0,10 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 7,640 | 13/05/2027 | 721 400 | (165) | (0,07) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 7,740 | 26/10/2028 | 3 525 000 | (722) | (0,30) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 7,770 | 27/10/2028 | 2 046 400 | 170 | 0,07 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,320 | 20/01/2028 | 729 300 | 207 | 0,09 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,500 | 25/01/2028 | 5 485 200 | 1 837 | 0,76 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,550 | 24/01/2028 | 1 174 900 | 372 | 0,15 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,650 | 19/01/2028 | 731 300 | 238 | 0,10 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,712 | 28/04/2028 | 2 440 200 | 508 | 0,21 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,740 | 28/04/2028 | 4 994 100 | 1 769 | 0,74 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 8,800 | 27/04/2028 | 1 126 200 | 481 | 0,20 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 9,490 | 11/04/2028 | 2 501 700 | (1 258) | (0,52) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 9,500 | 11/04/2028 | 1 025 500 | (517) | (0,22) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 9,510 | 11/04/2028 | 1 038 900 | (564) | (0,23) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 9,625 | 15/08/2027 | 695 900 | 280 | 0,12 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 9,750 | 22/11/2027 | 283 976 | 105 | 0,04 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 9,800 | 16/11/2027 | 2 235 924 | 827 | 0,34 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 9,900 | 16/12/2027 | 162 500 | (65) | (0,03) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 10,000 | 18/11/2027 | 319 400 | 125 | 0,05 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 10,050 | 15/12/2027 | 164 000 | (68) | (0,03) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 10,070 | 18/07/2027 | 428 900 | 130 | 0,05 |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 10,100 | 15/07/2027 | 488 900 | 149 | 0,06 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 10,340 | 15/12/2027 | 334 200 | (148) | (0,06) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 11,140 | 23/12/2027 | 2 021 500 | (1 017) | (0,42) |
| À payer | BBR HUF à 6 mois | 11,350 | 11/11/2027 | 289 300 | 125 | 0,05 |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 11,524 | 12/09/2027 | 2 052 600 | (982) | (0,41) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 11,650 | 09/09/2027 | 359 200 | (184) | (0,08) |
| À recevoir | BBR HUF à 6 mois | 12,500 | 19/10/2027 | 4 079 400 | (2 614) | (1,09) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 0,481 | 11/08/2025 | PLN 3 400 | (78) | (0,03) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 0,560 | 17/04/2025 | 1 900 | (32) | (0,01) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 0,580 | 11/01/2026 | 8 500 | (229) | (0,10) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 0,585 | 22/09/2025 | 6 000 | (131) | (0,05) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 0,635 | 08/05/2025 | 1 100 | (19) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 0,730 | 05/02/2026 | 6 500 | 168 | 0,07 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 0,890 % | 12/02/2026 | PLN 20 900 | \$ 514 | 0,21 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 1,188 | 19/03/2026 | 17 800 | 337 | 0,14 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 1,229 | 09/03/2026 | 7 000 | 145 | 0,06 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 1,405 | 10/08/2026 | 27 100 | 641 | 0,27 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 1,450 | 05/07/2026 | 5 300 | (142) | (0,06) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 1,465 | 07/06/2026 | 2 400 | 43 | 0,02 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 2,185 | 08/10/2026 | 8 300 | (147) | (0,06) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 2,983 | 08/11/2026 | 20 100 | 224 | 0,09 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 3,525 | 24/12/2026 | 3 300 | (25) | (0,01) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 3,600 | 27/12/2026 | 3 300 | (24) | (0,01) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 3,739 | 03/01/2027 | 1 000 | (6) | 0,00 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 3,934 | 04/03/2027 | 19 200 | 100 | 0,04 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,219 | 04/02/2027 | 10 200 | 8 | 0,00 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 4,735 | 09/10/2028 | 10 200 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,830 | 18/03/2027 | 2 000 | (15) | (0,01) |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 4,840 | 22/08/2028 | 6 800 | (21) | (0,01) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 4,930 | 29/06/2028 | 15 900 | 181 | 0,08 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,179 | 01/04/2027 | 7 900 | (87) | (0,04) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,300 | 12/01/2028 | 23 800 | 296 | 0,12 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,430 | 16/03/2028 | 6 700 | 102 | 0,04 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 5,460 | 16/08/2027 | 1 300 | (22) | (0,01) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,490 | 12/12/2027 | 19 700 | 182 | 0,08 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,525 | 12/12/2027 | 6 500 | 62 | 0,03 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,540 | 01/06/2028 | 26 600 | 335 | 0,14 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,670 | 09/12/2027 | 19 500 | 212 | 0,09 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,750 | 08/12/2027 | 16 300 | 189 | 0,08 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,800 | 07/12/2027 | 32 600 | 392 | 0,16 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 5,830 | 08/12/2027 | 32 600 | 401 | 0,17 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,160 | 23/02/2028 | 42 600 | (996) | (0,41) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 6,310 | 18/11/2027 | 14 800 | 245 | 0,10 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,348 | 09/09/2027 | 14 800 | (238) | (0,10) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 6,365 | 17/11/2027 | 15 600 | 266 | 0,11 |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 6,455 | 16/11/2027 | 23 630 | 423 | 0,18 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 6,650 | 29/09/2027 | 33 200 | (799) | (0,33) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 7,223 | 29/06/2027 | 23 200 | 608 | 0,25 |
| À recevoir | WIBOR PLN à 6 mois | 7,726 | 24/10/2027 | 87 700 | (2 451) | (1,02) |
| À payer | WIBOR PLN à 6 mois | 7,761 | 21/10/2027 | 7 052 | 203 | 0,08 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 4,775 | 26/06/2025 | MXN 4 900 | 25 | 0,01 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 4,800 | 05/02/2026 | 65 500 | 317 | 0,13 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 5,080 | 09/10/2025 | 14 500 | (85) | (0,04) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 5,095 | 30/10/2025 | 23 500 | (133) | (0,06) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 5,120 | 06/05/2025 | 15 800 | (81) | (0,03) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 5,443 | 17/04/2025 | 5 700 | (31) | (0,01) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 5,550 | 12/03/2026 | 32 800 | 159 | 0,07 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 6,050 | 04/06/2026 | 22 600 | (100) | (0,04) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 6,095 | 20/03/2026 | 51 800 | 218 | 0,09 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 6,210 | 28/03/2025 | 4 300 | (28) | (0,01) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 6,230 | 07/04/2025 | 16 700 | (107) | (0,04) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 6,255 | 21/05/2026 | 23 500 | 100 | 0,04 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 6,460 | 18/06/2026 | 43 000 | 165 | 0,07 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 6,625 | 11/09/2026 | 21 100 | 82 | 0,03 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 6,635 | 11/09/2026 | 21 100 | 82 | 0,03 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 6,740 | 17/09/2026 | 28 500 | 105 | 0,04 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,109 | 03/12/2026 | 102 300 | (331) | (0,14) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 7,113 | 24/09/2026 | 134 600 | 417 | 0,17 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 7,264 | 17/12/2026 | 30 000 | 87 | 0,04 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,273 | 12/11/2026 | 33 880 | (99) | (0,04) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 7,353 | 05/11/2026 | 58 150 | 166 | 0,07 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,370 | 14/10/2026 | 24 200 | (68) | (0,03) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 7,383 | 28/01/2027 | 29 500 | 83 | 0,03 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,460 | 04/02/2027 | 44 800 | (119) | (0,05) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 7,530 | 14/01/2027 | 24 100 | 60 | 0,03 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 7,590 | 29/10/2026 | 40 000 | 94 | 0,04 |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 7,673 | 31/12/2026 | 23 900 | 56 | 0,02 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 7,745 | 11/02/2027 | 53 100 | (114) | (0,05) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,055 | 13/06/2033 | 25 800 | (56) | (0,02) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,207 | 19/06/2028 | 52 900 | 1 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,250 | 02/12/2032 | 85 900 | (109) | (0,05) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,280 | 29/07/2027 | 40 300 | (57) | (0,02) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,281 | 28/03/2033 | 68 000 | (48) | (0,02) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,340 | 21/04/2033 | 35 500 | (3) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,374 | 14/03/2033 | 135 600 | (57) | (0,02) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,400 | 21/05/2027 | 47 400 | (49) | (0,02) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,402 | 20/05/2027 | 34 800 | (36) | (0,01) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,438 | 20/03/2028 | 307 500 | (201) | (0,08) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,453 | 30/11/2027 | 332 600 | (239) | (0,10) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,470 | 16/12/2033 | 18 500 | 1 | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,480 | 30/11/2027 | 105 200 | (70) | (0,03) |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,498 | 11/03/2027 | 25 400 | (22) | (0,01) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,500 | 25/07/2033 | 91 300 | (15) | (0,01) |
| À recevoir | TIE MXN à 28 jours | 8,563 | 16/05/2033 | 31 700 | (11) | 0,00 |
| À payer | TIE MXN à 28 jours | 8,616 | 05/11/2027 | 165 400 | (69) | (0,03) |

| Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/(moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------------------|
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,620 % | 09/11/2027 | MXN 82 900 | \$ (3) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,645 | 27/07/2033 | 115 700 | (134) | (0,06) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,728 | 22/05/2028 | 135 300 | (10) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,740 | 30/08/2027 | 30 800 | (2) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,755 | 03/02/2033 | 45 900 | (51) | (0,02) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,765 | 02/08/2028 | 113 400 | (79) | (0,03) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,785 | 06/05/2027 | 24 900 | 8 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,800 | 02/02/2033 | 73 500 | (94) | (0,04) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 8,810 | 01/07/2027 | 60 100 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,844 | 07/02/2033 | 104 900 | (154) | (0,06) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,921 | 25/08/2027 | 61 100 | 3 | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,940 | 07/02/2028 | 136 200 | (57) | (0,02) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 8,990 | 10/08/2033 | 34 000 | (69) | (0,03) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,020 | 03/06/2027 | 91 300 | (22) | (0,01) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,060 | 14/09/2027 | 61 100 | (30) | (0,01) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,070 | 24/06/2027 | 13 500 | (3) | 0,00 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,114 | 24/06/2027 | 11 700 | (4) | 0,00 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,135 | 27/10/2033 | 63 600 | 165 | 0,07 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,215 | 09/02/2028 | 146 800 | (146) | (0,06) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,238 | 02/11/2028 | 99 700 | 144 | 0,06 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,290 | 23/09/2027 | 22 500 | 20 | 0,01 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,295 | 21/10/2027 | 116 100 | (111) | (0,05) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,300 | 24/09/2027 | 34 400 | 31 | 0,01 |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,345 | 16/02/2028 | 99 400 | (129) | (0,05) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,382 | 12/10/2027 | 153 800 | (166) | (0,07) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,390 | 07/10/2027 | 40 300 | (42) | (0,02) |
| À recevoir | TIIE MXN à 28 jours | 9,536 | 22/09/2027 | 67 800 | (90) | (0,04) |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,765 | 16/09/2033 | 43 100 | 221 | 0,09 |
| À payer | TIIE MXN à 28 jours | 9,890 | 22/09/2028 | 61 300 | 180 | 0,08 |
| À payer | CPURNSA | 2,500 | 29/03/2033 | \$ 12 400 | 42 | 0,02 |
| À recevoir | CPURNSA | 2,525 | 07/06/2033 | 1 700 | (19) | (0,01) |
| À recevoir | CPURNSA | 2,595 | 12/07/2033 | 5 200 | (67) | (0,03) |
| | | | | | \$ (5 407) | (2,25) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | \$ (4 669) | (1,94) |

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Taux variable à payer/à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net | |
|--------------|----------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|--------|
| BOA | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,750 % | 20/09/2028 | MYR 94 900 | \$ 77 | \$ (243) | \$ (166) | (0,07) | |
| GST | À payer | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/09/2028 | 201 010 | (336) | 203 | (133) | (0,05) | |
| | À recevoir | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,750 | 20/09/2028 | 91 300 | 157 | (317) | (160) | (0,07) | |
| SCX | À payer | KLIBOR MYR à 3 mois | 3,500 | 20/09/2028 | 73 890 | (142) | 93 | (49) | (0,02) | |
| | | | | | | | \$ (244) | \$ (264) | \$ (508) | (0,21) |

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

| Contrepartie | À payer/à recevoir | Titre | Nbre d'actions ou de parts | Taux variable | Montant notionnel | Date d'échéance | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--------------------|----------------------|----------------------------|---------------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| MEI | À recevoir | Indice BOVESPA Index | 251 | 0,000 % | BRL 32 527 | 14/02/2024 | \$ 0 | \$ 320 | \$ 320 | 0,13 |
| | À recevoir | Indice KOSPI2 Index | 13 750 000 | 0,000 | KRW 4 688 453 | 14/03/2024 | 0 | 232 | 232 | 0,10 |
| | À payer | Indice SET 50 Index | 178 800 | 0,000 | THB 154 546 | 28/03/2024 | 0 | (46) | (46) | (0,02) |
| | | | | | | | \$ 0 | \$ 506 | \$ 506 | 0,21 |

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD 11 915 | \$ 7 892 | \$ 0 | \$ (240) | \$ (240) | (0,10) |
| | 03/2024 | CNH 1 253 | 174 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BOA | 01/2024 | AUD 527 | 348 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value latente) | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | HUF 170 656 | \$ 469 | \$ 0 | \$ (23) | \$ (23) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ 775 988 | 5 258 | 0 | (249) | (249) | (0,10) |
| | 01/2024 | NOK 7 183 | 676 | 0 | (32) | (32) | (0,01) |
| | 01/2024 | PLN 24 665 | 5 660 | 0 | (610) | (610) | (0,25) |
| | 01/2024 | SEK 46 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | TRY 529 | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 22 | HUF 7 929 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 127 | PLN 533 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 83 967 | \$ 11 620 | 0 | (239) | (239) | (0,10) |
| | 03/2024 | IDR 151 302 556 | 9 811 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | KRW 2 843 500 | 2 200 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | PHP 2 359 | 42 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | AUD 222 | 146 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 305 | 224 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 1 295 | 1 413 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 1 415 | 1 795 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 8 825 | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 463 700 | 3 154 | 0 | (137) | (137) | (0,06) |
| | 01/2024 | NZD 16 552 | 10 178 | 0 | (302) | (302) | (0,13) |
| | 01/2024 | \$ 125 | AUD 184 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 66 | CAD 88 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 940 | € 857 | 9 | (2) | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | 164 | £ 128 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 482 | ¥ 70 667 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| | 01/2024 | 33 791 | MXN 619 708 | 2 639 | 0 | 2 639 | 1,10 |
| | 01/2024 | 25 124 | NZD 40 300 | 392 | 0 | 392 | 0,16 |
| | 01/2024 | 75 | PLN 318 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 16 583 | \$ 895 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 3 747 | 521 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 03/2024 | COP 85 863 | 21 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | HUF 313 748 | 900 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 104 774 | 3 319 | 0 | (153) | (153) | (0,06) |
| | 03/2024 | \$ 1 162 | AUD 1 700 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 9 400 | CAD 12 480 | 75 | 0 | 75 | 0,03 |
| | 03/2024 | 12 664 | CNH 89 528 | 0 | (19) | (19) | (0,01) |
| | 03/2024 | 64 | IDR 990 380 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 130 | ILS 7 703 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 03/2024 | 795 | INR 66 475 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 500 | MXN 25 816 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 900 | NOK 19 541 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| | 03/2024 | 2 886 | NZD 4 600 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | CAD 6 871 | \$ 5 053 | 0 | (159) | (159) | (0,07) |
| | 01/2024 | £ 12 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 602 | 138 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| | 01/2024 | TRY 207 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 245 | AUD 13 721 | 120 | 0 | 120 | 0,05 |
| | 01/2024 | 1 184 | BRL 5 878 | 26 | 0 | 26 | 0,01 |
| | 01/2024 | 43 | CAD 58 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 81 | HUF 29 681 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | 88 | ¥ 12 800 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | 111 | MXN 1 951 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01/2024 | 1 407 | PLN 6 074 | 137 | 0 | 137 | 0,06 |
| | 01/2024 | 5 | TRY 138 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 119 | ZAR 2 281 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 02/2024 | 7 | TRY 210 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CLP 2 686 | \$ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | £ 1 375 | 1 751 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 2 567 | 329 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 106 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 93 563 | 3 102 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 885 | ILS 3 200 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| CBK | 06/2024 | KRW 1 633 898 | \$ 1 252 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 01/2024 | COP 34 622 924 | 8 799 | 0 | (139) | (139) | (0,06) |
| | 01/2024 | MXN 9 374 | 534 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| | 01/2024 | NZD 11 348 | 7 005 | 0 | (180) | (180) | (0,07) |
| | 01/2024 | PLN 3 010 | 708 | 0 | (57) | (57) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 98 | AUD 146 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 3 374 | BRL 16 428 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | 17 781 | CHF 15 371 | 491 | 0 | 491 | 0,20 |
| | 01/2024 | 17 416 | COP 69 387 508 | 461 | 0 | 461 | 0,19 |
| | 01/2024 | 158 | € 144 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 31 212 | £ 24 568 | 108 | 0 | 108 | 0,04 |
| | 01/2024 | 32 | HUF 11 219 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 90 | MXN 1 555 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 107 | PLN 433 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 01/2024 | 30 | SEK 310 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 154 | ZAR 2 899 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 9 717 | \$ 528 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 48 474 960 | 3 120 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| | 03/2024 | ILS 13 558 | 3 724 | 0 | (50) | (50) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 14 | BRL 71 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 2 596 | IDR 40 022 615 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | 10 500 | INR 874 787 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | \$ 9 800 | KRW 12 649 854 | \$ 2 | \$ (2) | \$ 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 6 790 | PEN 25 562 | 98 | 0 | 98 | 0,04 |
| | 03/2024 | 1 651 | PLN 6 561 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 04/2024 | BRL 16 594 | \$ 3 374 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | 04/2024 | ILS 100 | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 6 296 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | \$ 1 085 | PLN 4 291 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 02/2024 | 3 801 | BRL 18 644 | 31 | 0 | 31 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH 15 003 | \$ 2 082 | 0 | (37) | (37) | (0,02) |
| | 03/2024 | SGD 4 133 | 3 122 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 614 | CZK 13 719 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03/2024 | 40 | SGD 53 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 1 766 386 | \$ 1 357 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| GLM | 01/2024 | BRL 2 899 | 590 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 31 250 | 23 006 | 0 | (695) | (695) | (0,29) |
| | 01/2024 | CHF 7 485 | 8 541 | 0 | (357) | (357) | (0,15) |
| | 01/2024 | ¥ 1 241 082 | 8 440 | 0 | (369) | (369) | (0,15) |
| | 01/2024 | MXN 203 083 | 11 577 | 0 | (361) | (361) | (0,15) |
| | 01/2024 | NOK 889 | 83 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 59 | € 54 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 100 | HUF 37 550 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | 71 | ZAR 1 341 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 02/2024 | TRY 564 | \$ 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 1 839 | 255 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | IDR 33 872 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 1 000 | BRL 4 867 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2024 | 28 | CZK 636 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 850 | IDR 13 088 340 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | BRL 19 415 | \$ 3 854 | 0 | (143) | (143) | (0,06) |
| | 01/2024 | HUF 42 863 | 121 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 3 460 | 196 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | PLN 932 | 213 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 4 011 | MXN 68 960 | 43 | 0 | 43 | 0,02 |
| | 01/2024 | 3 551 | PLN 15 503 | 391 | 0 | 391 | 0,16 |
| | 01/2024 | 3 | TRY 82 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 56 | ZAR 1 069 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02/2024 | INR 994 748 | \$ 11 907 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 02/2024 | \$ 1 731 | RON 7 870 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 03/2024 | CNH 20 429 | \$ 2 833 | 0 | (52) | (52) | (0,02) |
| | 03/2024 | ILS 11 041 | 3 024 | 0 | (49) | (49) | (0,02) |
| | 03/2024 | TWD 120 153 | 3 865 | 0 | (117) | (117) | (0,05) |
| | 03/2024 | \$ 2 600 | CHF 2 197 | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| | 03/2024 | 434 | IDR 6 707 489 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | 6 185 | ILS 22 278 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 03/2024 | 2 200 | ¥ 307 597 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| MBC | 06/2024 | KRW 1 577 864 | \$ 1 217 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | 01/2024 | AUD 5 068 | 3 360 | 0 | (98) | (98) | (0,04) |
| | 01/2024 | € 5 636 | 6 197 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 66 573 | 181 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 064 | AUD 1 571 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 01/2024 | 661 | € 606 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | 271 | £ 214 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 421 | ¥ 60 300 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | 134 | MXN 2 486 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| | 01/2024 | 43 | PLN 184 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 1 124 | \$ 144 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | TWD 37 987 | 1 204 | 0 | (55) | (55) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 8 921 | CNH 63 291 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| | 03/2024 | 217 | HKD 1 692 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 1 379 | IDR 21 255 709 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 03/2024 | 7 222 | PHP 404 156 | 73 | 0 | 73 | 0,03 |
| MYI | 01/2024 | € 13 | \$ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 172 | 216 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 145 049 | 388 | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ 1 623 433 | 11 019 | 0 | (503) | (503) | (0,21) |
| | 01/2024 | MYR 25 123 | 5 384 | 0 | (99) | (99) | (0,04) |
| | 01/2024 | \$ 40 002 | CAD 53 543 | 609 | 0 | 609 | 0,25 |
| | 01/2024 | 20 | € 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 590 | £ 462 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 88 | HUF 31 368 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | 53 | MXN 914 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 4 651 | NOK 48 165 | 93 | 0 | 93 | 0,04 |
| | 01/2024 | 397 | PLN 1 625 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 01/2024 | 137 | ZAR 2 549 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 8 076 | \$ 434 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 1 429 | 198 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2024 | CZK 3 693 | 165 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | HUF 319 594 | 900 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| | 03/2024 | IDR 11 077 534 | 720 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 2 628 | AUD 3 900 | 40 | 0 | 40 | 0,02 |
| | 03/2024 | 9 415 | BRL 46 914 | 185 | 0 | 185 | 0,08 |
| | 03/2024 | 4 700 | CAD 6 197 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 03/2024 | 388 | IDR 5 965 505 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 03/2024 | \$ 1 000 | NOK 10 089 | \$ 0 | \$ (5) | \$ (5) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 1 015 778 | \$ 781 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| RBC | 04/2024 | MXN 371 328 | 20 991 | 0 | (557) | (557) | (0,23) |
| RYL | 01/2024 | \$ 77 | CAD 103 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 8 998 | € 8 222 | 87 | 0 | 87 | 0,04 |
| | 01/2024 | 33 134 | ¥ 4 778 400 | 780 | 0 | 780 | 0,32 |
| SCX | 01/2024 | £ 5 666 | \$ 7 167 | 0 | (56) | (56) | (0,02) |
| | 01/2024 | SEK 70 168 | 6 756 | 0 | (208) | (208) | (0,09) |
| | 01/2024 | TRY 72 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 3 455 | 477 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 03/2024 | HKD 22 032 | 2 826 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | THB 243 851 | 7 055 | 0 | (137) | (137) | (0,06) |
| | 03/2024 | TWD 33 695 | 1 067 | 0 | (49) | (49) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 3 429 | CNH 24 768 | 70 | 0 | 70 | 0,03 |
| | 03/2024 | 111 | IDR 1 696 780 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 06/2024 | KRW 2 423 665 | \$ 1 867 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| SOG | 02/2024 | RON 8 000 | 1 744 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 03/2024 | TWD 34 680 | 1 101 | 0 | (48) | (48) | (0,02) |
| SSB | 01/2024 | CLP 2 566 931 | 2 904 | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 2 706 | 3 415 | 0 | (35) | (35) | (0,01) |
| | 03/2024 | CLP 1 602 026 | 1 797 | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 1 500 | COP 5 997 000 | 24 | 0 | 24 | 0,01 |
| | 03/2024 | 1 013 | NZD 1 600 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 01/2024 | HUF 60 856 | \$ 163 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 8 | PLN 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | CNH 5 100 | \$ 706 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 53 | SGD 70 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | AUD 4 097 | \$ 2 718 | 0 | (78) | (78) | (0,03) |
| | 01/2024 | CAD 13 971 | 10 300 | 0 | (297) | (297) | (0,12) |
| | 01/2024 | £ 1 756 | 2 221 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| | 01/2024 | ¥ 1 508 891 | 10 300 | 0 | (410) | (410) | (0,17) |
| | 01/2024 | NOK 40 805 | 3 825 | 0 | (193) | (193) | (0,08) |
| | 01/2024 | SEK 29 448 | 2 853 | 0 | (69) | (69) | (0,03) |
| | 01/2024 | \$ 14 707 | SEK 150 115 | 192 | 0 | 192 | 0,08 |
| | 01/2024 | ZAR 16 616 | \$ 870 | 0 | (37) | (37) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 6 600 | CAD 8 816 | 93 | 0 | 93 | 0,04 |
| | | | | \$ 7 624 | \$ (8 319) | \$ (695) | (0,29) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 135 | \$ 148 | \$ 0 | \$ (2) | \$ (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 539 | € 495 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | € 101 | \$ 111 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 10 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 6 980 | € 6 351 | 37 | 0 | 37 | 0,02 |
| MYI | 01/2024 | 6 669 | 6 068 | 35 | 0 | 35 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | 6 601 | 6 001 | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| | | | | \$ 110 | \$ (3) | \$ 107 | 0,04 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BRC | 01/2024 | £ 1 314 | \$ 1 663 | \$ 0 | \$ (13) | \$ (13) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 127 | £ 101 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 45 | 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | 167 | 131 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 95 | \$ 121 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 72 | £ 56 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 1 632 | 1 285 | 7 | (1) | 6 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 19 665 | 15 545 | 153 | (1) | 152 | 0,07 |
| SSB | 01/2024 | 19 958 | 15 817 | 208 | 0 | 208 | 0,09 |
| UAG | 01/2024 | 19 929 | 15 747 | 146 | 0 | 146 | 0,06 |
| | | | | \$ 515 | \$ (15) | \$ 500 | 0,21 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (90) (0,04)

Total des Investissements

\$ 241 806 100,61

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (1 460) (0,61)

Actifs nets

\$ 240 346 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Affilié au Fonds.

(d) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,21 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|-------------------------|----------|--------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG | 0,898 % | 28/05/2024 | 31/03/2023 - 31/05/2023 | \$ 2 458 | \$ 2 456 | 1,02 |

Un montant en numéraire de 21 778 \$ (31 décembre 2022 : 21 987 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 4 760 \$ (31 décembre 2022 : 6 601 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 203 304 | \$ 0 | \$ 203 304 |
| Fonds d'investissement | 1 691 | 21 949 | 0 | 23 640 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 18 466 | 0 | 18 466 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 1 550 | (5 154) | 0 | (3 604) |
| Totaux | \$ 3 241 | \$ 238 565 | \$ 0 | \$ 241 806 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 335 879 | \$ 0 | \$ 335 879 |
| Fonds d'investissement | 10 879 | 30 814 | 0 | 41 693 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 27 452 | 0 | 27 452 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 467 | (2 020) | 0 | (1 553) |
| Dépôts auprès d'établissements de crédit | 0 | 600 | 0 | 600 |
| Totaux | \$ 11 346 | \$ 392 725 | \$ 0 | \$ 404 071 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (243) | \$ 260 | \$ 17 | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | (1 323) | 1 370 | 47 | (475) | 490 | 15 |
| BPS | 2 550 | (2 380) | 170 | (159) | 380 | 221 |
| BRC | 102 | (80) | 22 | (2 750) | 2 340 | (410) |
| CBK | 684 | (830) | (146) | 1 779 | (2 180) | (401) |
| CKL | S/O | S/O | S/O | 22 | 0 | 22 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | 157 | 0 | 157 |
| DUB | (42) | 80 | 38 | S/O | S/O | S/O |
| GLM | (1 794) | 1 680 | (114) | (251) | 330 | 79 |
| GST | (293) | 270 | (23) | (299) | 261 | (38) |
| HUS | S/O | S/O | S/O | 267 | (260) | 7 |
| IND | S/O | S/O | S/O | (8) | 0 | (8) |
| JPM | 80 | (100) | (20) | 153 | (390) | (237) |
| MBC | (24) | 0 | (24) | 931 | (880) | 51 |
| MEI | 506 | (690) | (184) | (165) | 450 | 285 |
| MYC | S/O | S/O | S/O | 204 | 0 | 204 |
| MYI | 316 | (550) | (234) | (99) | 120 | 21 |
| RBC | (557) | 330 | (227) | (69) | 50 | (19) |
| RYL | 868 | (940) | (72) | (21) | 0 | (21) |
| SCX | (309) | 360 | 51 | 1 408 | (1 310) | 98 |

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| SOG | \$ (79) | \$ 0 | \$ (79) | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 |
| SSB | 134 | (270) | (136) | 38 | 0 | 38 |
| TOR | (26) | 60 | 34 | (1 737) | 1 620 | (117) |
| UAG | (640) | 350 | (290) | (761) | 560 | (201) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 56,26 | 28,54 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé | 28,33 | 48,50 |
| Fonds d'investissement | 9,84 | 9,56 |
| Contrats de mise en pension | 7,68 | 6,30 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,48 | 0,13 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (1,94) | (0,06) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,04) | (0,42) |
| Certificats de dépôt | S/O | 0,14 |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Obligations et billets privés | 57,56 | 39,15 |
| Obligations et billets municipaux | S/O | 0,23 |
| Agences du gouvernement américain | 14,95 | 1,39 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 0,50 | 0,45 |
| Titres adossés à des actifs | 5,59 | 1,06 |
| Émissions souveraines | 1,89 | 0,53 |
| Instruments à court terme | 4,10 | 34,23 |
| Fonds d'investissement | 9,84 | 9,56 |
| Contrats de mise en pension | 7,68 | 6,30 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,48 | 0,13 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,31 | 0,09 |
| Swaps de taux d'intérêt | (2,25) | (0,15) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,21) | 0,04 |
| Swaps de rendement total sur indices | 0,21 | (0,04) |
| Contrats de change à terme | (0,29) | (1,20) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,25 | 0,78 |
| Certificats de dépôt | S/O | 0,14 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (0,61) | 7,31 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| SINGAPOUR | | | | 3,250 % éch. 12/02/2027 | £ 200 | \$ 189 | 0,05 | Manchester Airport Group Funding PLC | £ 800 | \$ 891 | 0,25 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,369 % éch. 31/01/2031 | 1 500 | 1 559 | 0,43 | 6,125 % éch. 30/09/2041 | 800 | 891 | 0,25 |
| DBS Bank Ltd. | | | | 7,090 % éch. 06/11/2029 | 2 650 | 2 825 | 0,78 | Metropolitan Housing Trust Ltd. | 1 800 | 1 290 | 0,36 |
| 5,851 % éch. 17/11/2026 | £ 200 | \$ 200 | 0,06 | 8,407 % éch. 14/11/2032 | 300 | 320 | 0,09 | 1,875 % éch. 28/07/2036 | 1 800 | 1 290 | 0,36 |
| ESPAGNE | | | | Berkeley Group PLC | 1 200 | 929 | 0,26 | Mitchells & Butlers Finance PLC | 404 | 383 | 0,11 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,500 % éch. 11/08/2031 | 1 200 | 929 | 0,26 | 6,013 % éch. 15/12/2030 | 404 | 383 | 0,11 |
| Abertis Infraestructuras S.A. | | | | Beyond Housing Ltd. | 250 | 150 | 0,04 | 6,135 % éch. 15/12/2030 | \$ 1 070 | 779 | 0,22 |
| 3,375 % éch. 27/11/2026 | 200 | 191 | 0,05 | 2,125 % éch. 17/05/2051 | 250 | 150 | 0,04 | Morhomes PLC | £ 1 100 | 901 | 0,25 |
| Banco Santander S.A. | | | | BG Energy Capital PLC | € 1 146 | 944 | 0,26 | 3,400 % éch. 19/02/2040 | £ 1 100 | 901 | 0,25 |
| 1,500 % éch. 14/04/2026 | 700 | 646 | 0,18 | 2,250 % éch. 21/11/2029 | € 1 146 | 944 | 0,26 | Motability Operations Group PLC | 950 | 654 | 0,18 |
| CaixaBank S.A. | | | | 5,000 % éch. 04/11/2036 | £ 300 | 310 | 0,09 | 2,125 % éch. 18/01/2042 | 950 | 654 | 0,18 |
| 1,500 % éch. 03/12/2026 | 500 | 466 | 0,13 | Blend Funding PLC | 800 | 639 | 0,18 | 3,625 % éch. 10/03/2036 | 1 250 | 1 139 | 0,32 |
| International Consolidated Airlines Group S.A. | € 1 100 | 927 | 0,26 | 3,459 % éch. 21/09/2049 | 800 | 639 | 0,18 | 5,625 % éch. 29/11/2030 | 100 | 108 | 0,03 |
| 3,750 % éch. 25/03/2029 | € 1 100 | 927 | 0,26 | BP Capital Markets PLC | 600 | 657 | 0,18 | 5,625 % éch. 11/09/2035 | 1 100 | 1 196 | 0,33 |
| Lorca Telecom Bondco S.A. | | | | British Land Co. PLC | 2 100 | 1 816 | 0,50 | National Gas Transmission PLC | 800 | 635 | 0,18 |
| 4,000 % éch. 18/09/2027 | 400 | 339 | 0,09 | 2,375 % éch. 14/09/2029 | 2 100 | 1 816 | 0,50 | 1,375 % éch. 07/02/2031 | 800 | 635 | 0,18 |
| Total Espagne | | 2 569 | 0,71 | British Telecommunications PLC | 1 000 | 1 097 | 0,30 | National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC | 400 | 326 | 0,09 |
| SUPRANATIONALES | | | | 6,375 % éch. 23/06/2037 | 1 000 | 1 097 | 0,30 | National Grid Electricity Distribution West Midlands PLC | 1 600 | 1 706 | 0,47 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Cadent Finance PLC | 900 | 671 | 0,19 | National Grid Electricity Transmission PLC | 1 400 | 1 217 | 0,34 |
| Banque de développement asiatique | £ 2 550 | 2 610 | 0,72 | 2,250 % éch. 10/10/2035 | 900 | 671 | 0,19 | 1,125 % éch. 07/07/2028 | 1 400 | 1 217 | 0,34 |
| 6,125 % éch. 15/08/2025 | £ 2 550 | 2 610 | 0,72 | 2,625 % éch. 22/09/2038 | 950 | 690 | 0,19 | 2,000 % éch. 16/09/2038 | 1 600 | 1 098 | 0,30 |
| Banque de développement du Conseil de l'Europe | 1 250 | 1 162 | 0,32 | 5,750 % éch. 14/03/2034 | 500 | 522 | 0,14 | 2,750 % éch. 06/02/2035 | 900 | 729 | 0,20 |
| 1,250 % éch. 15/09/2026 | 1 250 | 1 162 | 0,32 | Clarion Funding PLC | 1 000 | 746 | 0,21 | Nationwide Building Society | 1 400 | 1 402 | 0,39 |
| Banque européenne d'investissement | 1 700 | 1 641 | 0,46 | 1,875 % éch. 22/01/2035 | 1 000 | 746 | 0,21 | 5,890 % éch. 24/10/2030 | 1 400 | 1 402 | 0,39 |
| 0,750 % éch. 15/11/2024 | 1 700 | 1 641 | 0,46 | 3,125 % éch. 19/04/2048 | 300 | 218 | 0,06 | 6,178 % éch. 07/12/2027 | 1 200 | 1 233 | 0,34 |
| 3,750 % éch. 07/12/2027 | 1 350 | 1 350 | 0,37 | Compass Group PLC | 1 100 | 1 111 | 0,31 | NatWest Group PLC | 1 800 | 1 608 | 0,44 |
| 4,500 % éch. 07/06/2029 | 1 000 | 1 044 | 0,29 | 4,375 % éch. 08/09/2032 | 1 100 | 1 111 | 0,31 | 2,057 % éch. 09/11/2028 | 1 800 | 1 608 | 0,44 |
| Banque internationale pour la reconstruction et le développement | 2 400 | 2 741 | 0,76 | Derwent London PLC | 1 500 | 1 196 | 0,33 | 2,875 % éch. 19/09/2026 | 500 | 479 | 0,13 |
| 5,750 % éch. 07/06/2032 | 2 400 | 2 741 | 0,76 | 1,875 % éch. 17/11/2031 | 1 500 | 1 196 | 0,33 | 3,125 % éch. 28/03/2027 | 500 | 475 | 0,13 |
| Association internationale de développement | 1 100 | 963 | 0,27 | Diageo Finance PLC | 1 700 | 1 379 | 0,38 | 3,619 % éch. 29/03/2029 | 900 | 844 | 0,23 |
| 0,750 % éch. 21/09/2028 | 1 100 | 963 | 0,27 | 2,750 % éch. 08/06/2038 | 1 700 | 1 379 | 0,38 | 7,416 % éch. 06/06/2033 | 600 | 628 | 0,17 |
| Société financière internationale | 1 500 | 1 348 | 0,37 | ENW Finance PLC | 400 | 334 | 0,09 | NatWest Markets PLC | 1 300 | 1 372 | 0,38 |
| 0,750 % éch. 22/07/2027 | 1 500 | 1 348 | 0,37 | 1,415 % éch. 30/07/2030 | 400 | 334 | 0,09 | 6,375 % éch. 08/11/2027 | 1 300 | 1 372 | 0,38 |
| Total Supranationales | | 12 859 | 3,56 | 4,893 % éch. 24/11/2032 | 1 700 | 1 748 | 0,48 | NIE Finance PLC | 1 100 | 1 190 | 0,33 |
| SUÈDE | | | | GlaxoSmithKline Capital PLC | 2 100 | 1 608 | 0,44 | 5,875 % éch. 01/12/2032 | 1 100 | 1 190 | 0,33 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 1,625 % éch. 12/05/2035 | 2 100 | 1 608 | 0,44 | Northern Gas Networks Finance PLC | 250 | 246 | 0,07 |
| Investor AB | 1 100 | 1 199 | 0,33 | Grainger PLC | 1 215 | 1 043 | 0,29 | 4,875 % éch. 15/11/2035 | 250 | 246 | 0,07 |
| 5,500 % éch. 05/05/2037 | 1 100 | 1 199 | 0,33 | 3,000 % éch. 03/07/2030 | 1 215 | 1 043 | 0,29 | 5,625 % éch. 23/03/2040 | 50 | 52 | 0,01 |
| Tele2 AB | € 500 | 364 | 0,10 | 3,375 % éch. 24/04/2028 | 400 | 370 | 0,10 | Northern Powergrid Yorkshire PLC | 300 | 295 | 0,08 |
| 0,750 % éch. 23/03/2031 | € 500 | 364 | 0,10 | Greene King Finance PLC | 351 | 315 | 0,09 | 4,375 % éch. 05/07/2032 | 300 | 295 | 0,08 |
| Total Suède | | 1 563 | 0,43 | 3,593 % éch. 15/03/2035 | 351 | 315 | 0,09 | 5,125 % éch. 04/05/2035 | 200 | 205 | 0,06 |
| SUISSE | | | | 4,064 % éch. 15/03/2035 | 195 | 179 | 0,05 | Northumbrian Water Finance PLC | 1 000 | 966 | 0,27 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,106 % éch. 15/03/2034 | 514 | 499 | 0,14 | 4,500 % éch. 14/02/2031 | 1 000 | 966 | 0,27 |
| Credit Suisse AG | £ 1 400 | 1 475 | 0,41 | 5,318 % éch. 15/09/2031 | 1 315 | 1 291 | 0,36 | 5,625 % éch. 29/04/2033 | 883 | 909 | 0,25 |
| 7,750 % éch. 10/03/2026 | £ 1 400 | 1 475 | 0,41 | Haleon UK Capital PLC | 1 450 | 1 369 | 0,38 | Notting Hill Genesis | 700 | 510 | 0,14 |
| UBS Group AG | 1 500 | 1 332 | 0,37 | 2,875 % éch. 29/10/2028 | 1 450 | 1 369 | 0,38 | 2,000 % éch. 03/06/2036 | 300 | 279 | 0,08 |
| 2,125 % éch. 15/11/2029 | 1 500 | 1 332 | 0,37 | 3,375 % éch. 29/03/2038 | 1 100 | 941 | 0,26 | 3,750 % éch. 20/12/2032 | 300 | 279 | 0,08 |
| 6,327 % éch. 22/12/2027 | \$ 1 500 | 1 213 | 0,33 | HSCB Holdings PLC | 1 700 | 1 530 | 0,42 | Pacific Quay Finance PLC | 150 | 156 | 0,04 |
| Total Suisse | | 4 020 | 1,11 | 3,000 % éch. 29/05/2030 | 1 700 | 1 530 | 0,42 | 5,565 % éch. 25/07/2034 | 150 | 156 | 0,04 |
| ROYAUME-UNI | | | | 6,000 % éch. 29/03/2040 | 978 | 986 | 0,27 | Paragon Treasury PLC | 100 | 72 | 0,02 |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,800 % éch. 14/09/2031 | 1 100 | 1 188 | 0,33 | 2,000 % éch. 07/05/2036 | 100 | 72 | 0,02 |
| 3i Group PLC | £ 850 | 685 | 0,19 | InterContinental Hotels Group PLC | 1 000 | 931 | 0,26 | Peabody Capital PLC | 900 | 667 | 0,18 |
| 3,750 % éch. 05/06/2040 | £ 850 | 685 | 0,19 | 2,125 % éch. 24/08/2026 | 1 000 | 931 | 0,26 | 3,250 % éch. 14/09/2048 | 900 | 667 | 0,18 |
| Anchor Hanover Group | 400 | 232 | 0,06 | 3,375 % éch. 08/10/2028 | 800 | 747 | 0,21 | Places for People Homes Ltd. | 900 | 852 | 0,24 |
| 2,000 % éch. 21/07/2051 | 400 | 232 | 0,06 | International Distributions Services PLC | 500 | 530 | 0,15 | 3,625 % éch. 22/11/2028 | 900 | 852 | 0,24 |
| Anglian Water Services Financing PLC | 1 400 | 1 482 | 0,41 | 7,375 % éch. 14/09/2030 | 500 | 530 | 0,15 | 5,875 % éch. 23/05/2031 | 568 | 596 | 0,16 |
| 5,875 % éch. 20/06/2031 | 1 400 | 1 482 | 0,41 | John Lewis PLC | 1 344 | 978 | 0,27 | Places for People Treasury PLC | 800 | 604 | 0,17 |
| Annington Funding PLC | 2 000 | 1 561 | 0,43 | 4,250 % éch. 18/12/2034 | 1 344 | 978 | 0,27 | 2,500 % éch. 26/01/2036 | 800 | 604 | 0,17 |
| 2,308 % éch. 06/10/2032 | 2 000 | 1 561 | 0,43 | 6,125 % éch. 21/01/2025 | 600 | 599 | 0,17 | Platform HG Financing PLC | 100 | 68 | 0,02 |
| 3,935 % éch. 12/07/2047 | 900 | 703 | 0,19 | Karbon Homes Ltd. | 400 | 321 | 0,09 | 1,926 % éch. 15/09/2041 | 100 | 68 | 0,02 |
| Assura Financing PLC | 500 | 375 | 0,10 | 3,375 % éch. 15/11/2047 | 400 | 321 | 0,09 | Prudential Funding Asia PLC | 580 | 608 | 0,17 |
| 1,625 % éch. 30/06/2033 | 500 | 375 | 0,10 | Land Securities Capital Markets PLC | 1 251 | 1 143 | 0,32 | 6,125 % éch. 19/12/2031 | 580 | 608 | 0,17 |
| Aviva PLC | 200 | 191 | 0,05 | 4,875 % éch. 15/09/2034 | 500 | 514 | 0,14 | Quadgas Finance PLC | 800 | 710 | 0,20 |
| 5,125 % éch. 04/06/2050 | 200 | 191 | 0,05 | Legal & General Group PLC | 1 200 | 1 193 | 0,33 | 3,375 % éch. 17/09/2029 | 800 | 710 | 0,20 |
| 6,875 % éch. 27/11/2053 | 400 | 420 | 0,12 | 5,375 % éch. 27/10/2045 | 1 200 | 1 193 | 0,33 | Reckitt Benckiser Treasury Services PLC | 1 100 | 1 235 | 0,34 |
| 6,875 % éch. 20/05/2058 | 1 600 | 1 662 | 0,46 | Liberty Living Finance PLC | 100 | 92 | 0,03 | 5,625 % éch. 14/12/2038 | 1 100 | 1 235 | 0,34 |
| Barclays PLC | 400 | 374 | 0,10 | 3,375 % éch. 28/11/2029 | 100 | 92 | 0,03 | Riverside Finance PLC | 900 | 731 | 0,20 |
| 1,700 % éch. 03/11/2026 | 400 | 374 | 0,10 | Lloyds Banking Group PLC | 5 100 | 4 649 | 1,29 | 3,875 % éch. 05/12/2044 | 900 | 731 | 0,20 |
| | | | | 2,000 % éch. 12/04/2028 | 5 100 | 4 649 | 1,29 | Rolls-Royce PLC | € 250 | 200 | 0,06 |
| | | | | 8,500 % éch. 27/09/2027 (c)(e) | 300 | 306 | 0,08 | 1,625 % éch. 09/05/2028 | € 250 | 200 | 0,06 |
| | | | | London & Quadrant Housing Trust | 1 250 | 855 | 0,24 | 5,750 % éch. 15/10/2027 | £ 900 | 906 | 0,25 |
| | | | | 2,000 % éch. 20/10/2038 | 1 250 | 855 | 0,24 | Sage Group PLC | 800 | 657 | 0,18 |
| | | | | 2,250 % éch. 20/07/2029 | 400 | 353 | 0,10 | 1,625 % éch. 25/02/2031 | 800 | 657 | 0,18 |
| | | | | M&G PLC | 400 | 382 | 0,11 | 2,875 % éch. 08/02/2034 | 1 500 | 1 267 | 0,35 |
| | | | | 5,625 % éch. 20/10/2051 | 400 | 382 | 0,11 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Santander UK Group Holdings PLC | £ 1 700 | \$ 1 520 | 0,42 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | Athene Global Funding | £ 400 | \$ 355 | 0,10 |
| 2,421 % éch. 17/01/2029 | 600 | 581 | 0,16 | Alba PLC | £ 766 | \$ 746 | 0,21 | Bank of America Corp. | 2 800 | 2 625 | 0,73 |
| 3,625 % éch. 14/01/2026 | 1 800 | 1 959 | 0,54 | 5,509 % éch. 15/12/2038 | | | | Becton Dickinson & Co. | 1 000 | 973 | 0,27 |
| 7,482 % éch. 29/08/2029 | | | | Albion PLC | 300 | 300 | 0,08 | 3,020 % éch. 24/05/2025 | | | |
| Scotland Gas Networks PLC | 300 | 293 | 0,08 | 0,000 % éch. 17/07/2066 | | | | Berkshire Hathaway Finance Corp. | 1 600 | 1 194 | 0,33 |
| 4,875 % éch. 21/12/2034 | | | | Atlas Funding PLC | 898 | 898 | 0,25 | 2,375 % éch. 19/06/2039 | | | |
| Scottish Hydro Electric Transmission PLC | 1 175 | 919 | 0,25 | 6,120 % éch. 25/07/2058 | | | | Cantor Fitzgerald LP | \$ 600 | 483 | 0,13 |
| 2,250 % éch. 27/09/2035 | | | | 6,348 % éch. 20/01/2061 | | | | 7,200 % éch. 12/12/2028 | | | |
| Segro PLC | 300 | 321 | 0,09 | Barley Hill PLC | 534 | 532 | 0,15 | Citigroup, Inc. | £ 1 000 | 926 | 0,26 |
| 5,750 % éch. 20/06/2035 | | | | 6,118 % éch. 27/08/2058 | | | | 1,750 % éch. 23/10/2026 | 650 | 649 | 0,18 |
| Severn Trent Utilities Finance PLC | 600 | 400 | 0,11 | Brants Bridge PLC | 185 | 186 | 0,05 | 2,750 % éch. 24/01/2024 | 1 060 | 1 068 | 0,29 |
| 2,000 % éch. 02/06/2040 | 400 | 392 | 0,11 | 6,470 % éch. 12/12/2064 | | | | 5,150 % éch. 21/05/2026 | | | |
| 4,625 % éch. 30/11/2034 | 800 | 779 | 0,22 | Canada Square Funding PLC | 58 | 58 | 0,02 | Comcast Corp. | 400 | 353 | 0,10 |
| 4,875 % éch. 24/01/2042 | 300 | 311 | 0,09 | 6,170 % éch. 17/06/2058 | | | | 1,500 % éch. 20/02/2029 | 1 200 | 907 | 0,25 |
| 5,250 % éch. 04/04/2036 | 1 300 | 1 395 | 0,39 | Eurohome UK Mortgages PLC | 63 | 63 | 0,02 | 1,875 % éch. 20/02/2036 | | | |
| 6,250 % éch. 07/06/2029 | | | | 5,490 % éch. 15/06/2044 | | | | Credit Suisse AG AT1 Claim | \$ 200 | 19 | 0,01 |
| Sky Ltd. | 500 | 495 | 0,14 | EuroMASTR PLC | 502 | 474 | 0,13 | Digital Stout Holding LLC | £ 1 675 | 1 564 | 0,43 |
| 4,000 % éch. 26/11/2029 | | | | 5,531 % éch. 15/06/2040 | | | | 3,750 % éch. 17/10/2030 | | | |
| Society of Lloyd's | 500 | 485 | 0,13 | Great Hall Mortgages PLC | 174 | 173 | 0,05 | Edison International | \$ 900 | 713 | 0,20 |
| 4,875 % éch. 07/02/2047 | | | | 5,469 % éch. 18/03/2039 | 2 | 2 | 0,00 | 7,875 % éch. 15/06/2054 | | | |
| South Eastern Power Networks PLC | 3 800 | 2 886 | 0,80 | 5,489 % éch. 18/06/2038 | | | | Fiserv, Inc. | £ 791 | 711 | 0,20 |
| 1,750 % éch. 30/09/2034 | | | | Harbour Energy PLC | 300 | 298 | 0,08 | 3,000 % éch. 01/07/2031 | | | |
| Southern Electric Power Distribution PLC | 800 | 857 | 0,24 | 6,120 % éch. 28/01/2054 | | | | Ford Motor Credit Co. LLC | 500 | 517 | 0,14 |
| 5,500 % éch. 07/06/2032 | | | | Hops Hill PLC | 604 | 604 | 0,17 | 6,860 % éch. 05/06/2026 | | | |
| Southern Gas Networks PLC | 1 600 | 1 286 | 0,36 | 6,148 % éch. 27/05/2054 | | | | General Motors Financial Co., Inc. | 500 | 503 | 0,14 |
| 3,100 % éch. 15/09/2036 | | | | London Wall Mortgage Capital PLC | 307 | 305 | 0,08 | 5,150 % éch. 15/08/2026 | | | |
| Southern Housing | 400 | 300 | 0,08 | 5,970 % éch. 15/05/2051 | | | | Goldman Sachs Group, Inc. | 1 600 | 1 335 | 0,37 |
| 2,375 % éch. 08/10/2036 | | | | Ludgate Funding PLC | 1 435 | 1 387 | 0,38 | 1,875 % éch. 16/12/2030 | 1 175 | 1 113 | 0,31 |
| Sovereign Housing Capital PLC | 1 000 | 638 | 0,18 | 6,014 % éch. 01/01/2061 | | | | 3,625 % éch. 29/10/2029 | | | |
| 2,375 % éch. 04/11/2048 | | | | Mansard Mortgages PLC | 67 | 66 | 0,02 | JPMorgan Chase & Co. | 1 500 | 1 231 | 0,34 |
| SW Finance PLC | 1 100 | 1 181 | 0,33 | 5,989 % éch. 15/12/2049 | | | | 1,895 % éch. 28/04/2033 | | | |
| 7,375 % éch. 12/12/2041 | | | | Mortimer BTL PLC | 1 388 | 1 380 | 0,38 | MassMutual Global Funding | 1 500 | 1 377 | 0,38 |
| Telereal Securitisation PLC | 124 | 123 | 0,03 | 4,924 % éch. 23/06/2053 | 812 | 813 | 0,22 | 1,375 % éch. 15/12/2026 | 1 500 | 1 533 | 0,42 |
| 4,974 % éch. 10/12/2033 | | | | 6,269 % éch. 23/03/2054 | | | | 5,000 % éch. 12/12/2027 | | | |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC | | | | Permanent Master Issuer PLC | 600 | 601 | 0,17 | McDonald's Corp. | 1 400 | 1 221 | 0,34 |
| 1,875 % éch. 02/11/2028 | 1 000 | 883 | 0,24 | 5,720 % éch. 15/07/2073 | | | | 2,950 % éch. 15/03/2034 (f) | 500 | 446 | 0,12 |
| 2,750 % éch. 27/04/2030 | 600 | 531 | 0,15 | Pierpont BTL PLC | 952 | 954 | 0,26 | 3,750 % éch. 31/05/2038 | | | |
| 5,500 % éch. 27/02/2035 | 300 | 304 | 0,08 | 6,320 % éch. 21/09/2054 | | | | Metropolitan Life Global Funding | 400 | 349 | 0,10 |
| Tesco Property Finance PLC | 273 | 275 | 0,08 | Polaris PLC | 654 | 653 | 0,18 | 0,625 % éch. 08/12/2027 | 400 | 347 | 0,10 |
| 5,661 % éch. 13/10/2041 | 960 | 971 | 0,27 | 5,985 % éch. 23/12/2058 | 1 083 | 1 087 | 0,30 | 1,625 % éch. 21/09/2029 | 740 | 724 | 0,20 |
| 5,744 % éch. 13/04/2040 | 274 | 281 | 0,08 | 6,496 % éch. 23/05/2059 | | | | 3,500 % éch. 30/09/2026 | 900 | 928 | 0,26 |
| 5,801 % éch. 13/10/2040 | 111 | 116 | 0,03 | Residential Mortgage Securities PLC | 963 | 965 | 0,27 | 5,000 % éch. 10/01/2030 | | | |
| 6,052 % éch. 13/10/2039 | | | | 6,470 % éch. 20/06/2070 | | | | Morgan Stanley | 600 | 640 | 0,18 |
| Thames Water Utilities Finance PLC | 800 | 493 | 0,14 | Stratton Mortgage Funding PLC | 61 | 61 | 0,02 | 5,789 % éch. 18/11/2033 | | | |
| 2,375 % éch. 22/04/2040 | 1 300 | 1 173 | 0,32 | 6,069 % éch. 25/09/2051 | 57 | 57 | 0,02 | Nestle Holdings, Inc. | 750 | 669 | 0,18 |
| 3,500 % éch. 25/02/2028 | 1 000 | 796 | 0,22 | 6,120 % éch. 12/03/2052 | 1 104 | 1 104 | 0,31 | 2,500 % éch. 04/04/2032 | 700 | 748 | 0,21 |
| 4,625 % éch. 04/06/2046 | 400 | 456 | 0,13 | 6,121 % éch. 20/07/2060 | | | | 5,125 % éch. 21/09/2032 | | | |
| 7,738 % éch. 09/04/2058 | 500 | 562 | 0,16 | Toward Point Mortgage Funding PLC | 1 055 | 1 056 | 0,29 | New York Life Global Funding | 500 | 459 | 0,13 |
| 8,250 % éch. 25/04/2040 | | | | 6,365 % éch. 20/10/2051 | 208 | 209 | 0,06 | 1,250 % éch. 17/12/2026 | 1 600 | 1 594 | 0,44 |
| Together Housing Finance PLC | 100 | 92 | 0,03 | 6,571 % éch. 20/07/2045 | | | | 4,350 % éch. 16/09/2025 | 900 | 935 | 0,26 |
| 4,500 % éch. 17/12/2042 | | | | Twinn Bridges PLC | 1 208 | 1 204 | 0,33 | 4,950 % éch. 07/12/2029 | | | |
| TP ICAP Finance PLC | 1 650 | 1 382 | 0,38 | 6,070 % éch. 12/03/2055 | | | | Pacific Life Global Funding | 1 100 | 1 122 | 0,31 |
| 2,625 % éch. 18/11/2028 | | | | | | | | 5,000 % éch. 12/01/2028 | 300 | 311 | 0,09 |
| Travis Perkins PLC | 600 | 566 | 0,16 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 5,375 % éch. 30/11/2028 | | | |
| 3,750 % éch. 17/02/2026 | | | | Bon du Trésor britannique | | | | PacifiCorp | \$ 900 | 694 | 0,19 |
| Uniqe Pub Finance Co. PLC | 792 | 792 | 0,22 | 0,125 % éch. 30/01/2026 | 11 000 | 10 231 | 2,83 | 5,500 % éch. 15/05/2054 | | | |
| 5,659 % éch. 30/06/2027 | 46 | 46 | 0,01 | 0,875 % éch. 31/01/2046 | 800 | 428 | 0,12 | Pfizer, Inc. | £ 1 000 | 758 | 0,21 |
| 7,395 % éch. 28/03/2024 | | | | 1,250 % éch. 31/07/2051 | 3 400 | 1 812 | 0,50 | 2,735 % éch. 15/06/2043 | | | |
| UNITE Group PLC | 900 | 856 | 0,24 | 1,500 % éch. 31/07/2053 | 10 100 | 5 633 | 1,56 | Procter & Gamble Co. | 400 | 445 | 0,12 |
| 3,500 % éch. 15/10/2028 | | | | 1,625 % éch. 22/10/2028 (f) | 12 400 | 11 483 | 3,18 | 6,250 % éch. 31/01/2030 | | | |
| Weir Group PLC | 900 | 950 | 0,26 | 3,500 % éch. 22/10/2025 (f) | 10 500 | 10 417 | 2,89 | Protective Life Global Funding | 1 100 | 1 136 | 0,31 |
| 6,875 % éch. 14/06/2028 | | | | 3,750 % éch. 29/01/2038 | 700 | 686 | 0,19 | 5,248 % éch. 13/01/2028 | | | |
| Wellcome Trust Ltd. | 650 | 293 | 0,08 | 3,750 % éch. 22/07/2052 | 2 300 | 2 161 | 0,60 | Realty Income Corp. | 825 | 628 | 0,17 |
| 1,500 % éch. 14/07/2071 | | | | 3,750 % éch. 22/10/2053 | 9 700 | 9 063 | 2,51 | 1,750 % éch. 13/07/2033 | 100 | 105 | 0,03 |
| Workspace Group PLC | 1 000 | 859 | 0,24 | Total Royaume-Uni | | 189 515 | 52,49 | 5,750 % éch. 05/12/2031 | 300 | 323 | 0,09 |
| 2,250 % éch. 11/03/2028 | | | | ÉTATS-UNIS | | | | 6,000 % éch. 05/12/2039 | | | |
| Yorkshire Building Society | 800 | 667 | 0,18 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Time Warner Cable LLC | 900 | 901 | 0,25 |
| 1,500 % éch. 15/09/2029 | | | | Amgen, Inc. | 740 | 730 | 0,20 | 5,750 % éch. 02/06/2031 | | | |
| Yorkshire Water Finance PLC | 949 | 715 | 0,20 | 4,000 % éch. 13/09/2029 | | | | Toyota Motor Credit Corp. | 300 | 317 | 0,09 |
| 1,750 % éch. 27/10/2032 | 700 | 485 | 0,13 | AT&T, Inc. | 1 800 | 1 560 | 0,43 | 5,625 % éch. 23/10/2028 | | | |
| 2,750 % éch. 18/04/2041 | 900 | 900 | 0,25 | 4,250 % éch. 01/06/2043 | 1 000 | 988 | 0,27 | Verizon Communications, Inc. | 500 | 424 | 0,12 |
| 5,250 % éch. 28/04/2030 | 500 | 495 | 0,14 | 4,375 % éch. 14/09/2029 | 900 | 1 054 | 0,29 | 1,875 % éch. 19/09/2030 | 1 400 | 1 222 | 0,35 |
| 5,500 % éch. 28/04/2035 | | | | 7,000 % éch. 30/04/2040 | | | | 2,500 % éch. 08/04/2031 | 1 200 | 1 031 | 0,28 |
| | | 120 781 | 33,45 | | | | | 3,375 % éch. 27/10/2036 | | | |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|--------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 0,500 % | 21/09/2024 | £ 52 400 | £ (338) | (0,09) |
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 2,728 | 16/12/2025 | 10 300 | 138 | 0,04 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 | 20/03/2054 | 2 400 | (220) | (0,06) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 3 200 | (207) | (0,06) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 2 900 | (58) | (0,02) |
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 37 600 | 425 | 0,12 |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 15/12/2026 | \$ 3 100 | 53 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 17/06/2030 | 9 000 | (303) | (0,09) |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 18/12/2029 | 9 300 | (292) | (0,08) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 12/02/2045 | 2 100 | 156 | 0,04 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,500 | 20/12/2033 | 600 | (28) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,750 | 20/12/2024 | 11 400 | 32 | 0,01 |
| À payer ⁽³⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | AUD 8 900 | 117 | 0,03 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | € 1 600 | 81 | 0,02 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 500 | (49) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 400 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 600 | (9) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,890 | 22/12/2033 | 400 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,910 | 29/12/2033 | 300 | (9) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 300 | (6) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 4 280 | 198 | 0,05 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,063 | 06/12/2033 | 200 | (8) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,128 | 04/12/2033 | 200 | (9) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,148 | 20/11/2033 | 300 | (9) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 200 | (5) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 7 700 | 205 | 0,06 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 06/11/2033 | 300 | (13) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 300 | (9) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,270 | 08/11/2028 | 600 | (15) | (0,01) |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,280 | 22/11/2033 | 200 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,305 | 27/11/2033 | 300 | (17) | (0,01) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 5 100 | 59 | 0,01 |
| | | | | | £ (167) | (0,05) |
| | | | | | £ (111) | (0,03) |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|--------|--------------|---------------------|
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 % | 18/01/2024 | 200 | £ 0 | £ 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 300 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 600 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 400 | (1) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | £ (11) | £ (13) | 0,00 |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 603 | £ 475 | £ 2 | £ 0 | £ 2 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | HUF 298 959 | \$ 851 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |

Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 2 296 | £ 1 810 | \$ 9 | \$ 0 | \$ 9 | 0,00 |
| | 01/2024 | 2 | HUF 855 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | € 1 679 | £ 1 450 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | HUF 87 567 | \$ 250 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 25 100 | £ 139 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | € 2 008 | £ 1 737 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 052 | 834 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | HUF 521 594 | \$ 1 486 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| MBC | 01/2024 | € 476 | £ 409 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 30 973 | \$ 88 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 900 | £ 2 280 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | € 3 410 | £ 2 938 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 129 | € 150 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 7 325 | \$ 9 300 | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| | 01/2024 | HUF 79 166 | 225 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 14 900 | £ 80 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 909 | 720 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | € 18 179 | 15 783 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| | 01/2024 | £ 395 | \$ 496 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | € 2 371 | £ 2 766 | 26 | 0 | 26 | 0,01 |
| UAG | 01/2024 | \$ 12 625 | £ 9 976 | 73 | 0 | 73 | 0,02 |
| | | | | £ 160 | £ (103) | £ 57 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | £ 44 | 0,01 |
| Total des Investissements | | | | | | £ 388 559 | 107,62 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | £ (27 498) | (7,62) |
| Actifs nets | | | | | | £ 361 061 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

- (a) Titre à coupon zéro.
(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.
(c) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
(d) Affilié au Fonds.
(e) Titre convertible conditionnel.
(f) Des titres d'une juste valeur globale de 21 034 £ (31 décembre 2022 : 0 £) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 483 £ (31 décembre 2022 : 0 £) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 3 382 £ (31 décembre 2022 : 7 199 £) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | £ 0 | £ 365 325 | £ 0 | £ 365 325 |
| Fonds d'investissement | 18 137 | 0 | 0 | 18 137 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 5 455 | 0 | 5 455 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (231) | (127) | 0 | (358) |
| Totaux | £ 17 906 | £ 370 653 | £ 0 | £ 388 559 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | £ 0 | £ 372 745 | £ 0 | £ 372 745 |
| Fonds d'investissement | 0 | 5 370 | 0 | 5 370 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 177 | 0 | 177 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 637 | 1 806 | 0 | 2 443 |
| Totaux | £ 637 | £ 380 098 | £ 0 | £ 380 735 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 4,500 % | 22/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | £ (503) | £ (506) | (0,14) |
| MEI | 5,140 | 27/11/2023 | 06/02/2024 | (11 044) | (11 099) | (3,07) |
| | 5,400 | 07/11/2023 | 06/02/2024 | (8 915) | (8 987) | (2,49) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | £ (20 592) | (5,70) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | £ 2 | £ 0 | £ 2 | £ 260 | £ (330) | £ (70) |
| BPS | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| BRC | (6) | 0 | (6) | S/O | S/O | S/O |
| CBK | (6) | 0 | (6) | S/O | S/O | S/O |
| GLM | 5 | 0 | 5 | (87) | 0 | (87) |
| GST | (2) | 0 | (2) | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (24) | 0 | (24) | S/O | S/O | S/O |
| MBC | 1 | 0 | 1 | (9) | 0 | (9) |
| MYC | (1) | 0 | (1) | S/O | S/O | S/O |
| MYI | (45) | 0 | (45) | (8) | 0 | (8) |
| SCX | 22 | 0 | 22 | S/O | S/O | S/O |
| SSB | 26 | 0 | 26 | (213) | 0 | (213) |
| UAG | 73 | 0 | 73 | S/O | S/O | S/O |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 96,47 | 94,43 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 4,71 | 1,35 |
| Autres valeurs mobilières | 0,01 | S/O |
| Fonds d'investissement | 5,02 | 1,38 |
| Contrats de mise en pension | 1,51 | 0,05 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,08) | 0,16 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,03) | 0,48 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,01 | (0,02) |
| Contrats de prise en pension | (5,70) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------|
| Australie | 0,42 | S/O |
| Autriche | S/O | 0,05 |
| Belgique | S/O | 0,07 |
| Canada | 0,95 | 0,20 |
| Îles Caïmans | 0,37 | 0,12 |
| République tchèque | 0,58 | S/O |
| Danemark | 1,27 | 0,82 |
| Finlande | 0,53 | S/O |
| France | 6,42 | 3,51 |
| Allemagne | 1,66 | 2,21 |
| Irlande | 1,20 | 1,24 |
| Italie | 1,31 | 0,57 |
| Japon | S/O | 0,31 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 2,61 | 1,71 |
| Luxembourg | 1,19 | 1,18 |
| Mexique | 0,11 | S/O |
| Pays-Bas | 5,46 | 5,67 |
| Norvège | 0,51 | 0,42 |
| Singapour | 0,06 | 0,20 |
| Espagne | 0,71 | 1,11 |
| Supranationales | 3,56 | 3,11 |
| Suède | 0,43 | 0,44 |
| Suisse | 1,11 | 0,89 |
| Royaume-Uni | 52,49 | 59,89 |
| États-Unis | 17,60 | 11,68 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Instruments à court terme | 0,64 | 0,38 |
| Fonds d'investissement | 5,02 | 1,38 |
| Contrats de mise en pension | 1,51 | 0,05 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,08) | 0,16 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines | | |
| - vente de protection | 0,02 | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,10 |
| Swaps de taux d'intérêt | (0,05) | 0,39 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,00 | (0,03) |
| Contrats de change à terme | 0,01 | 0,01 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (7,62) | 2,17 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | ITALIE | | | | NORVÈGE | | | |
| AUSTRALIE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Enel SpA | | | | Equinor ASA | | | |
| BHP Billiton Finance Ltd. | | | | 5,750 % éch. 22/06/2037 | £ 2 000 | £ 2 102 | 0,65 | 4,250 % éch. 10/04/2041 | £ 700 | £ 678 | 0,21 |
| 4,300 % éch. 25/09/2042 | £ 500 | £ 461 | 0,14 | Telecom Italia SpA | | | | SINGAPOUR | | | |
| BERMUDES | | | | 7,875 % éch. 31/07/2028 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Total Italie | | | | Temasek Financial Ltd. | | | |
| Aegon Ltd. | | | | | | 2 392 | 0,74 | 5,125 % éch. 26/07/2040 | 1 050 | 1 137 | 0,35 |
| 6,625 % éch. 16/12/2039 | 500 | 572 | 0,18 | JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES | | | | ESPAGNE | | | |
| ÎLES CAIMANS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | AA Bond Co. Ltd. | | | | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | |
| Southern Water Services Finance Ltd. | | | | 3,250 % éch. 31/07/2050 | £ 200 | 170 | 0,05 | 8,250 % éch. 30/11/2033 | 400 | 431 | 0,13 |
| 3,000 % éch. 28/05/2037 | 2 700 | 1 939 | 0,60 | 5,500 % éch. 31/07/2050 | 180 | 171 | 0,05 | SUÈDE | | | |
| 4,500 % éch. 31/03/2052 | 700 | 590 | 0,18 | Gatwick Funding Ltd. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Total Îles Caïmans | | 2 529 | 0,78 | 2,625 % éch. 07/10/2048 | 1 400 | 903 | 0,28 | Investor AB | | | |
| DANEMARK | | | | 2,875 % éch. 05/07/2051 | | | | 5,500 % éch. 05/05/2037 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 3,125 % éch. 28/09/2041 | | | | 1 300 | | | |
| Orsted A/S | | | | 3,250 % éch. 26/02/2050 | 1 700 | 1 214 | 0,37 | SUISSE | | | |
| 2,500 % éch. 16/05/2033 | 850 | 692 | 0,21 | 5,750 % éch. 23/01/2039 | 129 | 133 | 0,04 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 5,125 % éch. 13/09/2034 | 1 900 | 1 895 | 0,59 | Heathrow Funding Ltd. | | | | UBS Group AG | | | |
| 5,375 % éch. 13/09/2042 | 2 100 | 2 110 | 0,65 | 2,750 % éch. 09/08/2051 | 2 900 | 1 928 | 0,59 | 7,375 % éch. 07/09/2033 | | | |
| Total Danemark | | 4 697 | 1,45 | 4,625 % éch. 31/10/2048 | 2 377 | 2 193 | 0,68 | ROYAUME-UNI | | | |
| FRANCE | | | | 5,875 % éch. 13/05/2043 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | HSBC Bank Capital Funding Sterling LP | | | | 3i Group PLC | | | |
| AXA S.A. | | | | 5,844 % éch. 05/11/2031 (a) | 2 321 | 2 425 | 0,75 | 3,750 % éch. 05/06/2040 | 1 400 | 1 128 | 0,35 |
| 5,453 % éch. 04/03/2026 (a) | 600 | 594 | 0,18 | Total Jersey, Îles Anglo-normandes | | 11 414 | 3,51 | Accent Capital PLC | | | |
| BNP Paribas S.A. | | | | LUXEMBOURG | | | | 2,625 % éch. 18/07/2049 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 400 | | | |
| BNP Paribas S.A. | | | | Becton Dickinson Euro Finance SARL | | | | Anghian Water Services Financing PLC | | | |
| 2,000 % éch. 13/09/2036 | 1 600 | 1 192 | 0,37 | 1,336 % éch. 13/08/2041 | € 900 | 539 | 0,17 | 6,000 % éch. 20/06/2039 | | | |
| Électricité de France S.A. | | | | Nestle Finance International Ltd. | | | | Annington Funding PLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,125 % éch. 07/12/2038 | | | | 2 924 % éch. 06/10/2051 | | | |
| 5,125 % éch. 22/09/2050 | 4 800 | 4 474 | 1,38 | 5,125 % éch. 07/08/2041 | £ 500 | 533 | 0,16 | 3,685 % éch. 12/07/2034 | | | |
| 5,500 % éch. 27/03/2037 | 3 600 | 3 581 | 1,10 | Prologis International Funding S.A. | | | | Aviva PLC | | | |
| 5,500 % éch. 17/10/2041 | 4 800 | 4 730 | 1,46 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,000 % éch. 03/06/2055 | | | |
| 5,625 % éch. 25/01/2053 | 1 900 | 1 867 | 0,57 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,875 % éch. 27/11/2053 | | | |
| 6,000 % éch. 23/01/2114 | 400 | 392 | 0,12 | Total Luxembourg | | | | 700 | | | |
| Engie S.A. | | | | MEXIQUE | | | | 6,875 % éch. 20/05/2058 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Barclays PLC | | | |
| 5,000 % éch. 01/10/2060 | 700 | 695 | 0,21 | America Movil S.A.B. de C.V. | | | | 3,250 % éch. 17/01/2033 | | | |
| Orange S.A. | | | | 4,375 % éch. 07/08/2041 | | | | 8,875 % éch. 15/09/2027 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,948 % éch. 22/07/2033 | | | | (a)(b) | | | |
| 5,625 % éch. 23/01/2034 | 1 575 | 1 714 | 0,53 | | | | | 500 | | | |
| | | 19 239 | 5,92 | | | | | Berkeley Group PLC | | | |
| ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,500 % éch. 11/08/2031 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Beyond Housing Ltd. | | | |
| SNCF Réseau | | | | Obligation internationale du gouvernement mexicain | | | | 2,125 % éch. 17/05/2051 | | | |
| 4,830 % éch. 25/03/2060 | 3 160 | 3 213 | 0,99 | 5,625 % éch. 19/03/2114 | | | | 500 | | | |
| 5,000 % éch. 11/03/2052 | 400 | 412 | 0,13 | Total Mexique | | | | 1 716 | | | |
| | | 3 625 | 1,12 | PAYS-BAS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Total France | | 22 864 | 7,04 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | BP Capital Markets PLC | | | |
| ALLEMAGNE | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,773 % éch. 25/05/2038 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Cooperative Rabobank UA | | | | BPHA Finance PLC | | | |
| Bayer AG | | | | 5,250 % éch. 23/05/2041 | 1 050 | 1 164 | 0,36 | 4,816 % éch. 11/04/2044 | | | |
| 7,000 % éch. 25/09/2083 | € 900 | 807 | 0,25 | CTP NV | | | | British Land Co. PLC | | | |
| Deutsche Telekom AG | | | | 1,250 % éch. 21/06/2029 | | | | 2,375 % éch. 14/09/2029 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 4,750 % éch. 31/01/2034 | | | | 5,264 % éch. 24/09/2035 | | | |
| 3,125 % éch. 06/02/2034 | £ 800 | 717 | 0,22 | E.ON International Finance BV | | | | 400 | | | |
| Total Allemagne | | | | 5,875 % éch. 30/10/2037 | | | | British Telecommunications PLC | | | |
| | | 1 524 | 0,47 | 6,125 % éch. 06/07/2039 | | | | 3,625 % éch. 21/11/2047 | | | |
| IRLANDE | | | | Enel Finance International NV | | | | 5,750 % éch. 13/02/2041 | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | 5,750 % éch. 14/09/2040 | | | | 8,375 % éch. 20/12/2083 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Holcim Sterling Finance Netherlands BV | | | | Broadgate Financing PLC | | | |
| Toro European CLO DAC | | | | 3,000 % éch. 12/05/2032 | 300 | 261 | 0,08 | 4,999 % éch. 05/10/2033 | | | |
| 4,908 % éch. 12/01/2032 | € 1 300 | 1 117 | 0,34 | ING Groep NV | | | | 5,098 % éch. 05/04/2035 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,250 % éch. 20/05/2033 | | | | Cadent Finance PLC | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,250 % éch. 19/12/2039 | | | | 2,250 % éch. 10/10/2035 | | | |
| ESB Finance DAC | | | | JAB Holdings BV | | | | 2,625 % éch. 22/09/2038 | | | |
| 1,875 % éch. 21/07/2035 | £ 300 | 227 | 0,07 | Siemens Financieringsmaatschappij NV | | | | 2,750 % éch. 22/09/2046 | | | |
| Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. | | | | 3,750 % éch. 10/09/2042 | | | | 1 500 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Volkswagen Financial Services NV | | | | 300 | | | |
| 5,125 % éch. 23/11/2052 | 1 200 | 1 159 | 0,36 | 5,875 % éch. 23/05/2029 | | | | 900 | | | |
| | | 1 386 | 0,43 | Total Pays-Bas | | | | 13 885 | | | |
| Total Irlande | | 2 503 | 0,77 | | | | | 4,27 | | | |
| Catalyst Housing Ltd. | | | | Chancellor Masters & Scholars of the University of Cambridge | | | | 2,350 % éch. 27/06/2078 | | | |
| 3,125 % éch. 31/10/2047 | | | | 900 | | | | 652 | | | |
| | | | | 200 | | | | 129 | | | |
| | | | | | | | | 0,04 | | | |

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Church Commissioners for England 3,625 % éch. 14/07/2052 | £ 1 400 | £ 1 174 | 0,36 | Longstone Finance PLC 4,896 % éch. 19/04/2036 | £ 100 | £ 95 | 0,03 | Platform HG Financing PLC 1,926 % éch. 15/09/2041 | £ 1 200 | £ 813 | 0,25 |
| Citizen Treasury PLC 3,250 % éch. 20/10/2048 | 1 300 | 967 | 0,30 | M&G PLC 5,560 % éch. 20/07/2055 | 3 450 | 3 161 | 0,97 | Prudential Funding Asia PLC 6,125 % éch. 19/12/2031 | 620 | 650 | 0,20 |
| Clarion Funding PLC 1,250 % éch. 13/11/2032 | 100 | 76 | 0,02 | Manchester Airport Group Funding PLC 2,875 % éch. 30/09/2044 | 2 050 | 1 458 | 0,45 | RHP Finance PLC 3,250 % éch. 05/02/2048 | 700 | 544 | 0,17 |
| 1,875 % éch. 22/01/2035 | 3 600 | 2 687 | 0,83 | 6,125 % éch. 30/09/2041 | 200 | 223 | 0,07 | Riverside Finance PLC 3,875 % éch. 05/12/2044 | 600 | 487 | 0,15 |
| 1,875 % éch. 07/09/2051 | 2 600 | 1 380 | 0,43 | Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026 | 100 | 97 | 0,03 | Sage Group PLC 2,875 % éch. 08/02/2034 | 1 700 | 1 436 | 0,44 |
| 3,125 % éch. 19/04/2048 | 1 000 | 726 | 0,22 | Meadowhall Finance PLC 4,988 % éch. 12/07/2037 | 61 | 49 | 0,02 | Sanctuary Capital PLC 2,375 % éch. 14/04/2050 | 1 000 | 631 | 0,19 |
| Derwent London PLC 1,875 % éch. 17/11/2031 | 1 150 | 917 | 0,28 | Metropolitan Housing Trust Ltd. 1,875 % éch. 28/07/2036 | 2 400 | 1 720 | 0,53 | 5,000 % éch. 26/04/2047 | 500 | 496 | 0,15 |
| Diageo Finance PLC 2,750 % éch. 08/06/2038 | 2 200 | 1 785 | 0,55 | Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % éch. 15/12/2030 | 505 | 479 | 0,15 | Scottish Hydro Electric Transmission PLC 2,125 % éch. 24/03/2036 | 3 300 | 2 496 | 0,77 |
| Eastern Power Networks PLC 2,125 % éch. 25/11/2033 | 721 | 582 | 0,18 | 6,135 % éch. 15/12/2030 | \$ 606 | 442 | 0,14 | 2,250 % éch. 27/09/2035 | 400 | 313 | 0,10 |
| EMH Treasury PLC 4,500 % éch. 29/01/2044 | 800 | 749 | 0,23 | 7,214 % éch. 15/09/2034 | £ 993 | 826 | 0,25 | Segro PLC 5,750 % éch. 20/06/2035 | 300 | 321 | 0,10 |
| Eversholt Funding PLC 3,529 % éch. 07/08/2042 | 800 | 636 | 0,20 | Morhomes PLC 3,400 % éch. 19/02/2040 | 2 800 | 2 295 | 0,71 | Severn Trent Utilities Finance PLC 2,000 % éch. 02/06/2040 | 1 800 | 1 200 | 0,37 |
| Futures Treasury PLC 3,375 % éch. 08/02/2044 | 1 000 | 800 | 0,25 | Motability Operations Group PLC 1,500 % éch. 20/01/2041 | 800 | 506 | 0,16 | 4,625 % éch. 30/11/2034 | 300 | 294 | 0,09 |
| GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % éch. 12/05/2035 | 4 000 | 3 063 | 0,94 | 2,125 % éch. 18/01/2042 | 2 600 | 1 791 | 0,55 | 4,875 % éch. 24/01/2042 | 1 300 | 1 266 | 0,39 |
| 6,375 % éch. 09/03/2039 | 500 | 599 | 0,18 | 2,375 % éch. 03/07/2039 | 1 400 | 1 052 | 0,32 | 5,250 % éch. 04/04/2036 | 300 | 311 | 0,10 |
| Grainger PLC 3,000 % éch. 03/07/2030 | 2 100 | 1 802 | 0,56 | 4,875 % éch. 17/01/2043 | 1 100 | 1 111 | 0,34 | Society of Lloyd's 4,875 % éch. 07/02/2047 | 1 200 | 1 163 | 0,36 |
| 3,375 % éch. 24/04/2028 | 100 | 92 | 0,03 | 5,750 % éch. 11/09/2048 | 600 | 677 | 0,21 | South Eastern Power Networks PLC 1,750 % éch. 30/09/2034 | 5 000 | 3 797 | 1,17 |
| Great Places Housing Group Ltd. 4,750 % éch. 22/10/2042 | 1 000 | 967 | 0,30 | National Gas Transmission PLC 5,750 % éch. 05/04/2035 | 1 850 | 1 953 | 0,60 | Southern Electric Power Distribution PLC 4,625 % éch. 20/02/2037 | 1 500 | 1 466 | 0,45 |
| Greene King Finance PLC 3,593 % éch. 15/03/2035 | 702 | 629 | 0,19 | National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC 6,250 % éch. 10/12/2040 | 500 | 563 | 0,17 | Southern Gas Networks PLC 3,100 % éch. 15/09/2036 | 2 100 | 1 688 | 0,52 |
| 4,064 % éch. 15/03/2035 | 261 | 239 | 0,07 | National Grid Electricity Distribution South Wales PLC 1,625 % éch. 07/10/2035 | 1 100 | 781 | 0,24 | 6,375 % éch. 15/05/2040 | 600 | 654 | 0,20 |
| 5,106 % éch. 15/03/2034 | 2 076 | 2 017 | 0,62 | National Grid Electricity Distribution South West PLC 5,750 % éch. 23/03/2040 | 700 | 747 | 0,23 | 6,625 % éch. 14/03/2035 | 600 | 666 | 0,21 |
| 5,318 % éch. 15/09/2031 | 1 355 | 1 330 | 0,41 | National Grid Electricity Transmission PLC 2,000 % éch. 16/09/2038 | 1 200 | 823 | 0,25 | Southern Housing 2,375 % éch. 08/10/2036 | 1 500 | 1 124 | 0,35 |
| Guinness Partnership Ltd. 4,000 % éch. 24/10/2044 | 1 000 | 876 | 0,27 | 2,000 % éch. 17/04/2040 | 2 008 | 1 331 | 0,41 | 3,500 % éch. 19/10/2047 | 1 400 | 1 051 | 0,32 |
| Haleon UK Capital PLC 3,375 % éch. 29/03/2038 | 1 920 | 1 642 | 0,51 | 2,750 % éch. 06/02/2035 | 600 | 486 | 0,15 | Sovereign Housing Capital PLC 2,375 % éch. 04/11/2048 | 600 | 383 | 0,12 |
| Hexagon Housing Association Ltd. 3,625 % éch. 22/04/2048 | 1 300 | 978 | 0,30 | 5,272 % éch. 18/01/2043 | 2 000 | 2 019 | 0,62 | 5,705 % éch. 10/09/2039 | 700 | 763 | 0,24 |
| High Speed Rail Finance PLC 4,375 % éch. 01/11/2038 | 1 500 | 1 406 | 0,43 | Nationwide Building Society 5,875 % éch. 20/12/2024 (a)(b) | 700 | 689 | 0,21 | Standard Chartered PLC 4,375 % éch. 18/01/2038 | 900 | 848 | 0,26 |
| Home Group Ltd. 3,125 % éch. 27/03/2043 | 1 300 | 965 | 0,30 | NatWest Group PLC 3,619 % éch. 29/03/2029 | 2 000 | 1 876 | 0,58 | 5,125 % éch. 06/06/2034 | 500 | 476 | 0,15 |
| HSBC Holdings PLC 5,875 % éch. 28/09/2026 (a)(b) | 200 | 191 | 0,06 | Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % éch. 29/11/2035 | 400 | 425 | 0,13 | SW Finance PLC 7,375 % éch. 12/12/2041 | 800 | 859 | 0,26 |
| 6,000 % éch. 29/03/2040 | 1 000 | 1 009 | 0,31 | Northern Electric Finance PLC 2,750 % éch. 24/05/2049 | 2 150 | 1 499 | 0,46 | Telereal Secured Finance PLC 4,010 % éch. 10/12/2033 | 1 174 | 1 107 | 0,34 |
| Hyde Housing Association Ltd. 1,750 % éch. 18/08/2055 | 1 600 | 817 | 0,25 | Northern Gas Networks Finance PLC 4,875 % éch. 15/11/2035 | 900 | 885 | 0,27 | Telereal Securitisation PLC 6,165 % éch. 10/12/2033 | 82 | 84 | 0,03 |
| Jigsaw Funding PLC 3,375 % éch. 05/05/2052 | 800 | 631 | 0,19 | 5,625 % éch. 23/03/2040 | 800 | 827 | 0,25 | Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % éch. 27/02/2035 | 1 800 | 1 826 | 0,56 |
| John Lewis PLC 4,250 % éch. 18/12/2034 | 1 222 | 889 | 0,27 | Northern Powergrid Northeast PLC 1,875 % éch. 16/06/2062 | 100 | 53 | 0,02 | Tesco Property Finance PLC 5,411 % éch. 13/07/2044 | 1 970 | 1 916 | 0,59 |
| Juturna European Loan Conduit PLC 5,064 % éch. 10/08/2033 | 936 | 951 | 0,29 | 3,250 % éch. 01/04/2052 | 600 | 455 | 0,14 | 5,661 % éch. 13/10/2041 | 188 | 190 | 0,06 |
| Karbon Homes Ltd. 3,375 % éch. 15/11/2047 | 300 | 241 | 0,07 | Northern Powergrid Yorkshire PLC 2,250 % éch. 09/10/2059 | 1 000 | 577 | 0,18 | 5,744 % éch. 13/04/2040 | 2 854 | 2 887 | 0,89 |
| Land Securities Capital Markets PLC 2,625 % éch. 22/09/2039 | 1 373 | 1 083 | 0,33 | 5,125 % éch. 04/05/2035 | 710 | 728 | 0,22 | 5,801 % éch. 13/10/2040 | 322 | 329 | 0,10 |
| 2,750 % éch. 22/09/2059 | 301 | 195 | 0,06 | Northumbrian Water Finance PLC 4,500 % éch. 14/02/2031 | 800 | 772 | 0,24 | 6,052 % éch. 13/10/2039 | 111 | 116 | 0,04 |
| LCR Finance PLC 4,500 % éch. 07/12/2038 | 75 | 77 | 0,02 | 5,625 % éch. 29/04/2033 | 400 | 412 | 0,13 | Thames Water Utilities Finance PLC 2,375 % éch. 22/04/2040 | 1 100 | 678 | 0,21 |
| Legal & General Group PLC 4,500 % éch. 01/11/2050 | 400 | 369 | 0,11 | 6,375 % éch. 28/10/2034 | 1 020 | 1 095 | 0,34 | 2,625 % éch. 24/01/2032 | 300 | 235 | 0,07 |
| 5,500 % éch. 27/06/2064 | 900 | 890 | 0,27 | Notting Hill Genesis 2,000 % éch. 03/06/2036 | 2 534 | 1 846 | 0,57 | 4,375 % éch. 03/07/2034 | 3 700 | 3 155 | 0,97 |
| 5,625 % éch. 24/03/2031 (a)(b) | 900 | 766 | 0,24 | 3,250 % éch. 12/10/2048 | 1 141 | 839 | 0,26 | 5,125 % éch. 28/09/2037 | 800 | 700 | 0,22 |
| Lloyds Bank PLC 6,500 % éch. 17/09/2040 | 3 700 | 4 430 | 1,36 | 5,250 % éch. 07/07/2042 | 199 | 200 | 0,06 | 5,500 % éch. 11/02/2041 | 200 | 178 | 0,06 |
| Lloyds Banking Group PLC 2,707 % éch. 03/12/2035 | 127 | 102 | 0,03 | Optivo Finance PLC 2,857 % éch. 07/10/2035 | 2 200 | 1 776 | 0,55 | 7,738 % éch. 09/04/2058 | 600 | 684 | 0,21 |
| London & Quadrant Housing Trust 2,000 % éch. 31/03/2032 | 2 000 | 1 632 | 0,50 | Orbit Capital PLC 3,375 % éch. 14/06/2048 | 700 | 531 | 0,16 | 8,250 % éch. 25/04/2040 | 400 | 450 | 0,14 |
| 2,000 % éch. 20/10/2038 | 1 200 | 821 | 0,25 | Pacific Quay Finance PLC 5,565 % éch. 25/07/2034 | 748 | 781 | 0,24 | Together Housing Finance PLC 4,500 % éch. 17/12/2042 | 300 | 275 | 0,09 |
| 3,125 % éch. 28/02/2053 | 1 000 | 706 | 0,22 | Paragon Treasury PLC 2,000 % éch. 07/05/2036 | 1 300 | 935 | 0,29 | TP ICAP Finance PLC 2,625 % éch. 18/11/2028 | 1 000 | 838 | 0,26 |
| 3,750 % éch. 27/10/2049 | 300 | 238 | 0,07 | Peabody Capital PLC 3,250 % éch. 14/09/2048 | 2 400 | 1 778 | 0,55 | Unique Pub Finance Co. PLC 5,659 % éch. 30/06/2027 | 883 | 882 | 0,27 |
| 4,625 % éch. 05/12/2033 | 900 | 886 | 0,27 | 5,250 % éch. 17/03/2043 | 300 | 304 | 0,09 | 7,395 % éch. 28/03/2024 | 106 | 106 | 0,03 |
| | | | | Places for People Treasury PLC 2,500 % éch. 26/01/2036 | 1 100 | 831 | 0,26 | United Utilities Water Finance PLC 5,750 % éch. 26/06/2036 | 1 700 | 1 840 | 0,57 |
| | | | | 6,250 % éch. 06/12/2041 | 100 | 108 | 0,03 | University of Oxford 2,544 % éch. 08/12/2117 | 3 150 | 1 857 | 0,57 |
| | | | | | | | | Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030 | 1 100 | 965 | 0,30 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Vodafone Group PLC 3,000 % éch. 12/08/2056 | £ 2 100 | £ 1 353 | 0,42 | ÉMISSIONS SOUVERAINES | | | | 2,500 % éch. 14/01/2042 | £ 500 | £ 345 | 0,11 |
| 3,375 % éch. 08/08/2049 | 3 900 | 2 827 | 0,87 | Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 31/07/2051 (c) | £ 19 100 | £ 10 179 | 3,13 | 6,000 % éch. 05/12/2039 | 200 | 216 | 0,07 |
| Wellcome Trust Finance PLC 4,625 % éch. 25/07/2036 | 500 | 520 | 0,16 | 1,500 % éch. 31/07/2053 | 400 | 223 | 0,07 | Time Warner Cable LLC 5,250 % éch. 15/07/2042 | 2 986 | 2 654 | 0,82 |
| Wellcome Trust Ltd. 1,500 % éch. 14/07/2071 | 5 600 | 2 523 | 0,78 | 1,750 % éch. 22/07/2057 | 2 100 | 1 225 | 0,38 | Venture Global LNG, Inc. 9,500 % éch. 01/02/2029 | \$ 1 000 | 831 | 0,26 |
| 2,517 % éch. 07/02/2118 | 1 500 | 891 | 0,27 | 3,250 % éch. 22/01/2044 (c) | 3 300 | 2 909 | 0,90 | Verizon Communications, Inc. 1,875 % éch. 03/11/2038 | £ 2 700 | 1 834 | 0,56 |
| 4,000 % éch. 09/05/2059 | 400 | 379 | 0,12 | 3,750 % éch. 22/10/2053 | 2 800 | 2 616 | 0,80 | 3,125 % éch. 02/11/2035 | 600 | 507 | 0,16 |
| Workspace Group PLC 2,250 % éch. 11/03/2028 | 450 | 387 | 0,12 | | | 17 152 | 5,28 | 3,375 % éch. 27/10/2036 | 2 800 | 2 406 | 0,74 |
| Yorkshire Housing Finance PLC 4,125 % éch. 31/10/2044 | 800 | 690 | 0,21 | Total Royaume-Uni | | 196 195 | 60,41 | 4,750 % éch. 17/02/2034 | 1 000 | 996 | 0,31 |
| Yorkshire Water Finance PLC 1,750 % éch. 27/10/2032 | 715 | 539 | 0,17 | ÉTATS-UNIS | | | | Walmart, Inc. 5,250 % éch. 28/09/2035 | 2 000 | 2 198 | 0,68 |
| 2,750 % éch. 18/04/2041 | 1 100 | 763 | 0,24 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 5,625 % éch. 27/03/2034 | 1 600 | 1 795 | 0,55 |
| 5,500 % éch. 28/04/2035 | 1 300 | 1 288 | 0,40 | Apple, Inc. 3,600 % éch. 31/07/2042 | 1 400 | 1 277 | 0,39 | Wells Fargo & Co. 2,125 % éch. 24/09/2031 | 400 | 329 | 0,10 |
| | | 172 371 | 53,08 | AT&T, Inc. 4,250 % éch. 01/06/2043 | 5 113 | 4 430 | 1,36 | 4,625 % éch. 02/11/2035 | 1 729 | 1 688 | 0,52 |
| TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | 4,875 % éch. 01/06/2044 | 4 038 | 3 765 | 1,16 | 4,875 % éch. 29/11/2035 | 1 700 | 1 606 | 0,49 |
| Atlas Funding PLC 6,348 % éch. 20/01/2061 | 581 | 583 | 0,18 | Berkshire Hathaway Finance Corp. 2,375 % éch. 19/06/2039 | 400 | 299 | 0,09 | Welltower OP LLC 4,500 % éch. 01/12/2034 | 1 000 | 948 | 0,29 |
| Great Hall Mortgages PLC 4,082 % éch. 18/06/2038 | € 2 | 2 | 0,00 | 2,625 % éch. 19/06/2059 | 1 700 | 1 092 | 0,34 | | | 45 331 | 13,96 |
| 5,469 % éch. 18/03/2039 | £ 3 | 3 | 0,00 | Charter Communications Operating LLC 5,125 % éch. 01/07/2049 | \$ 500 | 319 | 0,10 | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | |
| Hops Hill PLC 6,148 % éch. 27/05/2054 | 378 | 378 | 0,12 | Citigroup, Inc. 6,800 % éch. 25/06/2038 | £ 2 000 | 2 396 | 0,74 | Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 5,970 % éch. 25/04/2035 | \$ 136 | 94 | 0,03 |
| Mansard Mortgages PLC 5,989 % éch. 15/12/2049 | 106 | 105 | 0,03 | 7,375 % éch. 01/09/2039 | 400 | 508 | 0,16 | GSR Mortgage Loan Trust 5,778 % éch. 25/09/2035 | 0 | 0 | 0,00 |
| Mortimer BTL PLC 5,920 % éch. 23/06/2053 | 902 | 897 | 0,28 | Comcast Corp. 1,875 % éch. 20/02/2036 | 2 400 | 1 814 | 0,56 | Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 5,916 % éch. 15/12/2030 | 3 | 2 | 0,00 |
| 6,269 % éch. 23/03/2054 | 721 | 722 | 0,22 | Credit Suisse AG AT1 Claim \$ Eli Lilly & Co. 1,625 % éch. 14/09/2043 | £ 700 | 452 | 0,14 | Sequoia Mortgage Trust 3,675 % éch. 20/07/2037 | 6 | 4 | 0,00 |
| Newgate Funding PLC 4,525 % éch. 15/12/2050 | € 1 148 | 976 | 0,30 | Entergy Corp. 3,750 % éch. 15/06/2050 | \$ 57 | 34 | 0,01 | | | 100 | 0,03 |
| 5,509 % éch. 01/12/2050 | £ 56 | 54 | 0,02 | Goldman Sachs Group, Inc. 3,625 % éch. 29/10/2029 | £ 1 800 | 1 705 | 0,52 | AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN | | | |
| Pierpont BTL PLC 6,320 % éch. 21/09/2054 | 857 | 858 | 0,26 | JPMorgan Chase & Co. 1,895 % éch. 28/04/2033 | 1 400 | 1 149 | 0,35 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA | | | |
| Polaris PLC 5,985 % éch. 23/12/2058 | 374 | 373 | 0,11 | McDonald's Corp. 2,950 % éch. 15/03/2034 (c) | 400 | 349 | 0,11 | 4,000 % éch. 01/02/2054 | 5 900 | 4 382 | 1,35 |
| Stratton Mortgage Funding PLC 6,121 % éch. 20/07/2060 | 581 | 581 | 0,18 | 3,750 % éch. 31/05/2038 | 2 100 | 1 873 | 0,58 | 4,500 % éch. 01/02/2054 | 3 000 | 2 283 | 0,70 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | 470 | 471 | 0,14 | Mondelez International, Inc. 3,875 % éch. 06/03/2045 | 100 | 81 | 0,02 | 5,000 % éch. 01/02/2054 | 4 400 | 3 416 | 1,05 |
| Twin Bridges PLC 6,070 % éch. 12/03/2055 | 671 | 669 | 0,21 | Morgan Stanley 5,789 % éch. 18/11/2033 | 800 | 853 | 0,26 | 5,500 % éch. 01/02/2054 | 4 100 | 3 231 | 0,99 |
| | | 6 672 | 2,05 | National Fuel Gas Co. 2,950 % éch. 01/03/2031 | \$ 159 | 105 | 0,03 | 6,500 % éch. 01/02/2054 | 5 600 | 4 501 | 1,39 |
| | | | | Pfizer, Inc. 2,735 % éch. 15/06/2043 | £ 4 600 | 3 489 | 1,07 | | | 17 813 | 5,48 |
| | | | | Realty Income Corp. 1,750 % éch. 13/07/2033 | 1 100 | 837 | 0,26 | Total États-Unis | | 63 244 | 19,47 |
| | | | | | | | | Total des Valeurs mobilières | £ 330 293 | 101,70 | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|---|------------------|--|--|---------------------|
| SCX | 5,160 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | £ 6 500 | Bon du Trésor britannique indexé sur l'inflation 3,750 % éch. 22/10/2053 | £ (6 625) | £ 6 500 | £ 6 504 | 2,00 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | £ (6 625) | £ 6 500 | £ 6 504 | 2,00 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 21 | £ (32) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 3 | (7) | 0,00 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Schatz mars | Long | 03/2024 | 48 | 28 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 14 | (95) | (0,03) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 44 | (57) | (0,02) |

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 13 | £ 17 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Long | 03/2024 | 35 | 22 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 57 | 172 | 0,05 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars | Long | 03/2024 | 7 | 30 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 3 | (14) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars | Long | 03/2024 | 202 | 1 142 | 0,35 |
| | | | | £ 1 206 | 0,37 |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | £ 1 206 | 0,37 |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Cellnex Telecom S.A. | 5,000 % | 20/12/2033 | € 700 | £ 48 | 0,02 |
| Deutsche Lufthansa AG | 1,000 | 20/12/2028 | 1 100 | 2 | 0,00 |
| | | | | £ 50 | 0,02 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|---|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,250 % | 20/03/2054 | £ 5 800 | £ 749 | 0,23 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,000 | 20/03/2029 | 9 300 | (280) | (0,09) |
| À payer ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 5,500 | 20/03/2026 | 9 500 | 70 | 0,02 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 16/12/2030 | \$ 3 700 | 458 | 0,14 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,250 | 16/12/2050 | 100 | 29 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,500 | 18/12/2029 | 2 700 | 400 | 0,12 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,625 | 16/01/2050 | 100 | 35 | 0,01 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 21/06/2047 | 1 300 | 443 | 0,14 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 1,750 | 18/12/2049 | 400 | 143 | 0,05 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 2,000 | 12/02/2045 | 6 600 | 2 218 | 0,68 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | CAD 14 000 | 170 | 0,05 |
| À payer ⁽³⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,750 | 20/12/2033 | AUD 8 100 | 103 | 0,03 |
| À payer | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,547 | 09/03/2033 | € 1 400 | 43 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 3 200 | (264) | (0,08) |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 6 300 | 313 | 0,10 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,250 | 20/03/2029 | 500 | (16) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,500 | 20/03/2026 | 4 300 | (59) | (0,02) |
| | | | | | £ 4 555 | 1,40 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | | £ 4 605 | 1,42 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

⁽³⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 128 | £ 101 | £ 0 | £ 0 | £ 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | 487 | 384 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | € 185 | 160 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 15 300 | 82 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | £ 99 | CAD 171 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 689 | € 801 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 355 | £ 278 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 444 | \$ 557 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 23 100 | £ 124 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | € 5 862 | 5 089 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| UAG | 01/2024 | £ 445 | \$ 564 | £ 0 | £ (3) | £ (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 639 | £ 2 085 | £ 14 | £ 0 | £ 14 | 0,01 |
| | | | | £ 34 | £ (17) | £ 17 | 0,01 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | £ 17 | 0,01 |
| Total des Investissements | | | | | | £ 342 621 | 105,50 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | £ (17 853) | (5,50) |
| Actifs nets | | | | | | £ 324 768 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(b) Titre convertible conditionnel.

(c) Des titres d'une juste valeur globale de 4 309 £ (31 décembre 2022 : 0 £) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 197 £ (31 décembre 2022 : 0 £) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 3 754 £ (31 décembre 2022 : 10 123 £) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | £ 0 | £ 330 293 | £ 0 | £ 330 293 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 6 500 | 0 | 6 500 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 1 036 | 4 792 | 0 | 5 828 |
| Totaux | £ 1 036 | £ 341 585 | £ 0 | £ 342 621 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|------------------|
| Valeurs mobilières | £ 0 | £ 309 110 | £ 0 | £ 309 110 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 269 | 0 | 269 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (1 767) | 6 087 | 0 | 4 320 |
| Totaux | £ (1 767) | £ 315 466 | £ 0 | £ 313 699 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BPS | 4,500 % | 22/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | £ (168) | £ (168) | (0,05) |
| CEW | 5,360 | 07/11/2023 | 06/02/2024 | (2 675) | (2 697) | (0,83) |
| MEI | 5,400 | 07/11/2023 | 06/02/2024 | (1 072) | (1 081) | (0,34) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | £ (3 946) | (1,22) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | | | |
|--------------|--|-----|-------------------------|--|-------|-------------------------|-----------------------------------|-----|-------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | | Garantie (reçue)/nantie | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | | |
| | £ | S/O | £ | S/O | £ | S/O | £ | S/O | |
| BOA | | | | | 408 | | (510) | | (102) |
| BPS | 2 | | 0 | | | | | | S/O |
| BRC | (3) | | 0 | | 1 | | 0 | | 1 |
| GLM | 3 | | 0 | | (76) | | 0 | | (76) |
| JPM | | S/O | | S/O | 48 | | 0 | | 48 |
| MBC | 5 | | 0 | | 9 | | 0 | | 9 |
| MYI | (10) | | 0 | | 2 | | 0 | | 2 |
| SCX | 9 | | 0 | | (4) | | 0 | | (4) |
| SSB | | S/O | | S/O | (239) | | 0 | | (239) |
| UAG | 11 | | 0 | | (12) | | 0 | | (12) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 95,70 | 93,60 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 5,95 | 1,51 |
| Autres valeurs mobilières | 0,05 | S/O |
| Contrats de mise en pension | 2,00 | 0,08 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,37 | (0,54) |
| Instruments financiers dérivés compensés | 1,42 | 1,83 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,01 | 0,04 |
| Contrats de prise en pension | (1,22) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Australie | 0,14 | S/O |
| Belgique | S/O | 0,19 |
| Bermudes | 0,18 | S/O |
| Îles Caïmans | 0,78 | S/O |
| Danemark | 1,45 | 1,23 |
| France | 7,04 | 5,11 |
| Allemagne | 0,47 | 2,80 |
| Inde | S/O | 0,05 |
| Irlande | 0,77 | 2,32 |
| Italie | 0,74 | 0,78 |
| Japon | S/O | 0,09 |
| Jersey, Îles Anglo-normandes | 3,51 | 2,73 |
| Luxembourg | 0,56 | 1,21 |
| Mexique | 0,53 | 0,13 |
| Pays-Bas | 4,27 | 5,45 |
| Norvège | 0,21 | 0,27 |
| Singapour | 0,35 | 0,33 |
| Espagne | 0,13 | 0,22 |
| Supranationales | S/O | 1,18 |
| Suède | 0,44 | 0,16 |
| Suisse | 0,25 | 1,21 |
| Royaume-Uni | 60,41 | 52,18 |
| États-Unis | 19,47 | 13,85 |
| Instruments à court terme | S/O | 3,62 |
| Contrats de mise en pension | 2,00 | 0,08 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,37 | (0,54) |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | 0,02 | 0,05 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,14 |
| Swaps de taux d'intérêt | 1,40 | 1,64 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | S/O | (0,02) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection | S/O | 0,01 |
| Contrats de change à terme | 0,01 | 0,05 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (5,50) | 3,48 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | | | | | | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS | | | | | | | | | | | |
| Albion Financing SARL 10,924 % éch. 17/08/2026 | \$ 299 | \$ 302 | 0,02 | INEOS Enterprises Holdings U.S. Finco LLC 9,130 % - 9,238 % éch. 08/07/2030 | \$ 500 | \$ 501 | 0,03 | World Wide Technology Holding Co. LLC 8,707 % éch. 01/03/2030 | \$ 298 | \$ 300 | 0,01 |
| Altar Bidco, Inc. 8,262 % - 8,313 % éch. 01/02/2029 | 316 | 316 | 0,02 | Informatica LLC 8,220 % éch. 27/10/2028 | 349 | 350 | 0,02 | Worldpay LLC TBD % éch. 31/01/2031 | 1 900 | 1 911 | 0,10 |
| American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 7,356 % - 7,456 % éch. 15/01/2027 | 299 | 300 | 0,01 | Ingram Micro Inc. 8,610 % éch. 30/06/2028 | 466 | 468 | 0,02 | | | 44 758 | 2,39 |
| AppLovin Corp. 8,456 % éch. 16/08/2030 | 698 | 700 | 0,04 | Iridium Satellite LLC 7,856 % éch. 20/09/2030 | 310 | 311 | 0,02 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Aristocrat Technologies, Inc. 7,698 % éch. 24/05/2029 | 500 | 502 | 0,03 | Jane Street Group LLC 8,220 % éch. 26/01/2028 | 499 | 501 | 0,03 | BANQUE ET FINANCE | | | |
| Avis Budget Car Rental LLC 8,456 % éch. 16/03/2029 | 270 | 271 | 0,01 | Jazz Financing Lux SARL 8,970 % éch. 05/05/2028 | 648 | 652 | 0,03 | Alliant Holdings Intermediate LLC 7,000 % éch. 15/01/2031 | 6 600 | 6 966 | 0,37 |
| B&G Foods, Inc. 7,856 % éch. 10/10/2026 | 200 | 199 | 0,01 | LifePoint Health, Inc. 11,168 % éch. 16/11/2028 | 3 680 | 3 676 | 0,20 | Armor Holdco, Inc. 8,500 % éch. 15/11/2029 | 7 500 | 6 811 | 0,36 |
| Barnes Group, Inc. 8,456 % éch. 03/09/2030 | 349 | 351 | 0,02 | Live Nation Entertainment, Inc. 7,208 % éch. 19/10/2026 | 591 | 592 | 0,03 | BNP Paribas S.A. 8,500 % éch. 14/08/2028 (d)(f) | 1 500 | 1 575 | 0,08 |
| Calpine Construction Finance Co. LP 7,606 % éch. 31/07/2030 | 585 | 586 | 0,03 | MKS Instruments, Inc. 7,841 % éch. 17/08/2029 | 898 | 901 | 0,05 | Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % éch. 15/11/2027 | 300 | 268 | 0,01 |
| Calpine Corp. 7,970 % éch. 16/12/2027 | 382 | 384 | 0,02 | NorthRiver Midstream Finance LP 8,395 % éch. 16/08/2030 | 222 | 222 | 0,01 | Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % éch. 01/07/2031 | 6 250 | 6 650 | 0,36 |
| Castlelake Aviation Ltd. 8,135 % éch. 22/10/2027 | 396 | 397 | 0,02 | Ontario Gaming GTA LP 9,598 % éch. 01/08/2030 | 325 | 327 | 0,02 | Cantor Fitzgerald LP 7,200 % éch. 12/12/2028 | 1 000 | 1 026 | 0,06 |
| Castrol Pharma Solutions, Inc. 7,471 % éch. 22/02/2028 | 893 | 878 | 0,05 | Organon & Co. 8,472 % éch. 02/06/2028 | 714 | 717 | 0,04 | Credit Acceptance Corp. 9,250 % éch. 15/12/2028 | 1 300 | 1 387 | 0,07 |
| Central Parent, Inc. 9,348 % - 9,360 % éch. 06/07/2029 | 250 | 252 | 0,01 | Oryx Midstream Services Permian Basin LLC 8,710 % éch. 05/10/2028 | 319 | 320 | 0,02 | Curo Group Holdings Corp. 7,500 % éch. 01/08/2028 | 1 925 | 650 | 0,03 |
| Ciena Corp. 7,358 % éch. 24/10/2030 | 425 | 427 | 0,02 | Pacific Gas & Electric Co. 7,856 % éch. 23/06/2027 | 500 | 501 | 0,03 | Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC 8,875 % éch. 01/09/2031 | 1 700 | 1 803 | 0,10 |
| Delta SARL 7,598 % éch. 15/01/2030 | 525 | 527 | 0,03 | Parexel International Corp. 8,720 % éch. 15/11/2028 | 249 | 251 | 0,01 | Ford Motor Credit Co. LLC 3,375 % éch. 13/11/2025 | 1 700 | 1 627 | 0,09 |
| DiracTV Financing LLC 10,650 % éch. 02/08/2027 | 2 082 | 2 086 | 0,11 | PENN Entertainment, Inc. 8,206 % éch. 03/05/2029 | 296 | 297 | 0,01 | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % éch. 01/10/2025 | 3 222 | 3 215 | 0,17 |
| Elanco Animal Health, Inc. 7,193 % éch. 01/08/2027 | 499 | 496 | 0,03 | Polaris Newco LLC 9,470 % éch. 02/06/2028 | 399 | 394 | 0,02 | Freedom Mortgage Corp. 12,000 % éch. 01/10/2028 | 7 225 | 7 896 | 0,42 |
| Emrid Borrower LP 8,356 % - 8,380 % éch. 31/05/2030 | 567 | 570 | 0,03 | PRA Health Sciences, Inc. 7,860 % éch. 03/07/2028 | 100 | 100 | 0,01 | Getty Images, Inc. 9,750 % éch. 01/03/2027 | 8 250 | 8 334 | 0,45 |
| FinCo LLC 8,383 % éch. 27/06/2029 | 399 | 401 | 0,02 | Prime Security Services Borrower LLC 7,841 % éch. 14/10/2030 | 550 | 552 | 0,03 | Greystar Real Estate Partners LLC 7,750 % éch. 01/09/2030 | 1 100 | 1 154 | 0,06 |
| First Student Bidco, Inc. 8,360 % éch. 21/07/2028 | 119 | 118 | 0,01 | Rand Parent LLC 9,598 % éch. 17/03/2030 | 594 | 593 | 0,03 | HAT Holdings LLC 3,375 % éch. 15/06/2026 | 3 200 | 3 010 | 0,16 |
| Froneri International Ltd. 7,706 % éch. 29/01/2027 | 349 | 350 | 0,02 | Red Ventures LLC 8,356 % éch. 03/03/2030 | 199 | 199 | 0,01 | Howard Hughes Corp. 4,125 % éch. 01/02/2029 | 1 000 | 893 | 0,05 |
| Gen Digital, Inc. 7,456 % éch. 12/09/2029 | 976 | 979 | 0,05 | Reynolds Consumer Products LLC 7,206 % éch. 04/02/2027 | 292 | 293 | 0,01 | Intesa Sanpaolo SpA 4,198 % éch. 01/06/2032 | 3 150 | 2 601 | 0,14 |
| GFL Environmental, Inc. 7,912 % éch. 31/05/2027 | 509 | 511 | 0,03 | Reynolds Group Holdings, Inc. 8,720 % éch. 24/09/2028 | 683 | 685 | 0,04 | 5,710 % éch. 15/01/2026 | 1 975 | 1 967 | 0,11 |
| GIP Pilot Acquisition Partners LP 8,388 % éch. 04/10/2030 | 525 | 526 | 0,03 | Ryan Specialty Group LLC 8,456 % éch. 01/09/2027 | 577 | 577 | 0,03 | 7,700 % éch. 17/09/2025 (d)(f) | 2 000 | 1 970 | 0,11 |
| Go Daddy Operating Co. LLC 7,856 % éch. 09/11/2029 | 499 | 501 | 0,03 | Scientific Games International, Inc. 8,465 % éch. 14/04/2029 | 367 | 369 | 0,02 | 9,125 % éch. 07/09/2029 (d)(f) € | 2 500 | 3 045 | 0,16 |
| Graham Packaging Co., Inc. 8,470 % éch. 04/08/2027 | 379 | 380 | 0,02 | Select Medical Corp. 8,356 % éch. 06/03/2027 | 896 | 897 | 0,05 | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % éch. 12/11/2025 | 2 300 | 2 309 | 0,12 |
| Gray Television, Inc. 8,457 % éch. 01/12/2028 | 1 380 | 1 373 | 0,07 | Sotera Health Holdings LLC 8,395 % éch. 11/12/2026 | 500 | 500 | 0,03 | Midcap Financial Issuer Trust 5,625 % éch. 15/01/2030 | \$ 1 250 | 1 116 | 0,06 |
| Great Outdoors Group LLC 9,220 % éch. 06/03/2028 | 698 | 699 | 0,04 | Spirit Aerosystems, Inc. 9,633 % éch. 15/01/2027 | 299 | 301 | 0,02 | 6,500 % éch. 01/05/2028 | 700 | 656 | 0,04 |
| Grifols Worldwide Operations USA, Inc. 7,538 % éch. 15/11/2027 | 598 | 599 | 0,03 | SS&C Technologies, Inc. 7,706 % éch. 22/03/2029 | 570 | 572 | 0,03 | Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,125 % éch. 15/12/2030 | 5 000 | 4 527 | 0,24 |
| GVC Holdings (Gibraltar) Ltd. 8,948 % éch. 31/10/2029 | 549 | 550 | 0,03 | Tempo Acquisition LLC 8,106 % éch. 31/08/2028 | 499 | 502 | 0,03 | 5,750 % éch. 15/11/2031 | 1 000 | 934 | 0,05 |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. 7,455 % éch. 08/11/2030 | 500 | 502 | 0,03 | TransDigm, Inc. 8,598 % éch. 22/02/2027 | 399 | 401 | 0,02 | NCL Finance Ltd. 6,125 % éch. 15/03/2028 | 6 225 | 5 964 | 0,32 |
| Hilton Grand Vacations Borrower LLC 8,220 % éch. 02/08/2028 | 289 | 290 | 0,01 | U.S. Foods, Inc. 7,970 % éch. 22/11/2028 | 600 | 603 | 0,03 | OneMain Finance Corp. 3,500 % éch. 15/01/2027 | 4 650 | 4 307 | 0,23 |
| Hudson River Trading LLC 8,470 % éch. 20/03/2028 | 399 | 398 | 0,02 | Uber Technologies, Inc. 8,110 % - 8,135 % éch. 03/03/2030 | 790 | 794 | 0,04 | 4,000 % éch. 15/09/2030 | 4 000 | 3 429 | 0,18 |
| ICON Luxembourg SARL 7,860 % éch. 03/07/2028 | 372 | 374 | 0,02 | UPC Financing Partnership 8,476 % éch. 31/01/2029 | 800 | 799 | 0,04 | 5,375 % éch. 15/11/2029 | 3 000 | 2 814 | 0,15 |
| II-VI, Inc. 8,220 % éch. 02/07/2029 | 388 | 390 | 0,02 | USI, Inc. 8,348 % éch. 22/11/2029 | 365 | 366 | 0,02 | 6,625 % éch. 15/01/2028 | 1 500 | 1 515 | 0,08 |
| | | | | Virgin Media Bristol LLC 7,976 % éch. 31/01/2028 | 2 585 | 2 580 | 0,14 | 6,875 % éch. 15/03/2025 | 1 000 | 1 013 | 0,05 |
| | | | | VM Consolidated, Inc. 8,720 % éch. 24/03/2028 | 394 | 396 | 0,02 | 7,125 % éch. 15/03/2026 | 3 000 | 3 058 | 0,16 |
| | | | | | | | | 9,000 % éch. 15/01/2029 | 750 | 794 | 0,04 |
| | | | | | | | | Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % éch. 15/05/2029 | 1 000 | 927 | 0,05 |

Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,875 % éch. 01/10/2028 | \$ 1 500 | \$ 1 477 | 0,08 | 6,125 % éch. 01/12/2028 | \$ 2 000 | \$ 1 732 | 0,09 | 4,500 % éch. 01/06/2033 | \$ 7 000 | \$ 5 932 | 0,32 |
| PennyMac Financial Services, Inc. | | | | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC | | | | 4,750 % éch. 01/03/2030 | 5 000 | 4 576 | 0,24 |
| 5,375 % éch. 15/10/2025 | 1 000 | 989 | 0,05 | 3,250 % éch. 01/09/2028 | 2 000 | 1 752 | 0,09 | 5,000 % éch. 01/02/2028 | 2 000 | 1 915 | 0,10 |
| 5,750 % éch. 15/09/2031 | 2 000 | 1 854 | 0,10 | 4,000 % éch. 01/09/2029 | 2 000 | 1 695 | 0,09 | 5,125 % éch. 01/05/2027 | 600 | 580 | 0,03 |
| 7,875 % éch. 15/12/2029 | 2 400 | 2 474 | 0,13 | 6,000 % éch. 15/06/2027 | 1 000 | 997 | 0,05 | 5,375 % éch. 01/06/2029 | 4 000 | 3 776 | 0,20 |
| PRA Group, Inc. | | | | Ascent Resources Utica Holdings LLC | | | | 6,750 % éch. 15/07/2025 | 2 589 | 2 564 | 0,14 |
| 7,375 % éch. 01/09/2025 | 2 725 | 2 712 | 0,15 | 5,875 % éch. 30/06/2029 | 2 000 | 1 863 | 0,10 | Central Garden & Pet Co. | | | |
| Rocket Mortgage LLC | | | | 8,250 % éch. 31/12/2028 | 1 000 | 1 007 | 0,05 | 4,125 % éch. 15/10/2030 | 4 100 | 3 734 | 0,20 |
| 3,625 % éch. 01/03/2029 | 1 000 | 906 | 0,05 | Athenahealth Group, Inc. | | | | Central Parent LLC | | | |
| 3,875 % éch. 01/03/2031 | 2 000 | 1 761 | 0,09 | 6,500 % éch. 15/02/2030 | 5 000 | 4 543 | 0,24 | 8,000 % éch. 15/06/2029 | 2 400 | 2 507 | 0,13 |
| 4,000 % éch. 15/10/2033 | 2 000 | 1 701 | 0,09 | Avantor Funding, Inc. | | | | Cerba Healthcare SACA | | | |
| SBA Communications Corp. | | | | 4,625 % éch. 15/07/2028 | 6 000 | 5 803 | 0,31 | 3,500 % éch. 31/05/2028 | € 9 900 | 9 187 | 0,49 |
| 3,125 % éch. 01/02/2029 | 10 000 | 8 996 | 0,48 | Axalta Coating Systems LLC | | | | Charles River Laboratories International, Inc. | | | |
| 3,875 % éch. 15/02/2027 | 1 000 | 961 | 0,05 | 3,375 % éch. 15/02/2029 | 8 000 | 7 187 | 0,38 | 3,750 % éch. 15/03/2029 | \$ 2 000 | 1 834 | 0,10 |
| UBS Group AG | | | | B&G Foods, Inc. | | | | 4,000 % éch. 15/03/2031 | 100 | 90 | 0,00 |
| 9,250 % éch. 13/11/2028 (d)(f) | 300 | 324 | 0,02 | 8,000 % éch. 15/09/2028 | 4 750 | 4 994 | 0,27 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH | | | |
| UniCredit SpA | | | | B.C. Ltd. | | | | 5,500 % éch. 15/01/2028 | 800 | 757 | 0,04 |
| 5,459 % éch. 30/06/2035 | 1 000 | 942 | 0,05 | 9,000 % éch. 30/01/2028 | 2 150 | 2 098 | 0,11 | Chesapeake Energy Corp. | | | |
| USI, Inc. | | | | B.C. Unlimited Liability Co. | | | | 6,750 % éch. 15/04/2029 | 7 500 | 7 578 | 0,40 |
| 7,500 % éch. 15/01/2032 | 600 | 615 | 0,03 | 3,500 % éch. 15/02/2029 | 8 750 | 8 077 | 0,43 | Chobani LLC | | | |
| Voyager Aviation Holdings LLC | | | | 3,875 % éch. 15/01/2028 | 2 000 | 1 891 | 0,10 | 4,625 % éch. 15/11/2028 | 2 000 | 1 872 | 0,10 |
| 8,500 % éch. 09/05/2026 ^ | 1 805 | 981 | 0,05 | 4,000 % éch. 15/10/2030 | 11 575 | 10 396 | 0,56 | Churchill Downs, Inc. | | | |
| | | 159 091 | 8,49 | 4,375 % éch. 15/01/2028 | 2 000 | 1 912 | 0,10 | 4,750 % éch. 15/01/2028 | 5 000 | 4 795 | 0,26 |
| | | | | Ball Corp. | | | | 5,500 % éch. 01/04/2027 | 1 600 | 1 584 | 0,08 |
| INDUSTRIE | | | | 2,875 % éch. 15/08/2030 | 5 000 | 4 296 | 0,23 | 5,750 % éch. 01/04/2030 | 2 000 | 1 952 | 0,10 |
| 24 Hour Fitness Worldwide, Inc. | | | | 6,000 % éch. 15/06/2029 | 1 050 | 1 074 | 0,06 | 6,750 % éch. 01/05/2031 | 800 | 813 | 0,04 |
| 8,000 % éch. 01/06/2022 ^ | 9 500 | 24 | 0,00 | Bath & Body Works, Inc. | | | | Cimpress PLC | | | |
| Academy Ltd. | | | | 6,875 % éch. 01/11/2035 | 3 000 | 3 042 | 0,16 | 7,000 % éch. 15/06/2026 | 800 | 783 | 0,04 |
| 6,000 % éch. 15/11/2027 | 550 | 541 | 0,03 | 9,375 % éch. 01/07/2025 | 1 438 | 1 520 | 0,08 | Cinemark USA, Inc. | | | |
| Acushnet Co. | | | | Bausch & Lomb Escrow Corp. | | | | 5,250 % éch. 15/07/2028 | 1 225 | 1 125 | 0,06 |
| 7,375 % éch. 15/10/2028 | 350 | 365 | 0,02 | 8,375 % éch. 01/10/2028 | 7 225 | 7 631 | 0,41 | 5,875 % éch. 15/03/2026 | 600 | 588 | 0,03 |
| AdaptHealth LLC | | | | BCPE Empire Holdings, Inc. | | | | CITGO Petroleum Corp. | | | |
| 6,125 % éch. 01/08/2028 | 200 | 173 | 0,01 | 7,625 % éch. 01/05/2027 | 12 200 | 11 777 | 0,63 | 8,375 % éch. 15/01/2029 | 3 100 | 3 190 | 0,17 |
| Adient Global Holdings Ltd. | | | | Beacon Roofing Supply, Inc. | | | | Clarios Global LP | | | |
| 7,000 % éch. 15/04/2028 | 1 000 | 1 034 | 0,06 | 6,500 % éch. 01/08/2030 | 3 200 | 3 274 | 0,17 | 6,750 % éch. 15/05/2028 | 5 000 | 5 104 | 0,27 |
| ADT Security Corp. | | | | Block, Inc. | | | | Clarivate Science Holdings Corp. | | | |
| 4,875 % éch. 15/07/2032 | 3 200 | 2 963 | 0,16 | 3,500 % éch. 01/06/2031 | 5 000 | 4 449 | 0,24 | 4,875 % éch. 01/07/2029 | 5 000 | 4 697 | 0,25 |
| Advantage Sales & Marketing, Inc. | | | | Bombardier, Inc. | | | | Clear Channel International BV | | | |
| 6,500 % éch. 15/11/2028 | 5 725 | 5 282 | 0,28 | 6,000 % éch. 15/02/2028 | 3 000 | 2 926 | 0,16 | 6,625 % éch. 01/08/2025 | 1 300 | 1 307 | 0,07 |
| Ahead DB Holdings LLC | | | | 7,125 % éch. 15/06/2026 | 3 879 | 3 864 | 0,21 | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. | | | |
| 6,625 % éch. 01/05/2028 | 10 000 | 8 723 | 0,47 | 7,500 % éch. 01/02/2029 | 3 700 | 3 765 | 0,20 | 5,125 % éch. 15/08/2027 | 2 200 | 2 102 | 0,11 |
| Ahlstrom Holding Oy | | | | 7,875 % éch. 15/04/2027 | 2 611 | 2 614 | 0,14 | Cloud Software Group, Inc. | | | |
| 4,875 % éch. 04/02/2028 | 4 000 | 3 512 | 0,19 | Boyne USA, Inc. | | | | 6,500 % éch. 31/03/2029 | 7 000 | 6 673 | 0,36 |
| Air Canada | | | | 4,750 % éch. 15/05/2029 | 2 500 | 2 354 | 0,13 | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. | | | |
| 3,875 % éch. 15/08/2026 | 2 500 | 2 390 | 0,13 | Buckeye Partners LP | | | | 8,750 % éch. 15/04/2030 | 10 000 | 9 336 | 0,50 |
| 4,625 % éch. 15/08/2029 | CAD 1 750 | 1 230 | 0,07 | 4,125 % éch. 01/03/2025 | 2 000 | 1 941 | 0,10 | Coherent Corp. | | | |
| Albion Financing SARL | | | | 4,500 % éch. 01/03/2028 | 700 | 660 | 0,04 | 5,000 % éch. 15/12/2029 | 600 | 570 | 0,03 |
| 6,125 % éch. 15/10/2026 | \$ 4 250 | 4 215 | 0,23 | Builders FirstSource, Inc. | | | | CommScope, Inc. | | | |
| Allegiant Travel Co. | | | | 5,000 % éch. 01/03/2030 | 5 000 | 4 834 | 0,26 | 4,750 % éch. 01/09/2029 | 1 525 | 1 025 | 0,05 |
| 7,250 % éch. 15/08/2027 | 1 000 | 980 | 0,05 | CAB SELAS | | | | 6,000 % éch. 01/03/2026 | 2 500 | 2 230 | 0,12 |
| Allison Transmission, Inc. | | | | 3,375 % éch. 01/02/2028 | € 5 000 | 4 937 | 0,26 | Community Health Systems, Inc. | | | |
| 3,750 % éch. 30/01/2031 | 4 000 | 3 538 | 0,19 | Cable One, Inc. | | | | 4,750 % éch. 15/02/2031 | 5 000 | 3 937 | 0,21 |
| Altice Financing S.A. | | | | 4,000 % éch. 15/11/2030 | \$ 900 | 730 | 0,04 | 5,250 % éch. 15/05/2030 | 3 000 | 2 513 | 0,13 |
| 5,000 % éch. 15/01/2028 | 4 000 | 3 629 | 0,19 | Cablevision Lightpath LLC | | | | 5,625 % éch. 15/03/2027 | 6 650 | 6 187 | 0,33 |
| Altice France S.A. | | | | 5,625 % éch. 15/09/2028 | 4 000 | 3 157 | 0,17 | 8,000 % éch. 15/03/2026 | 741 | 739 | 0,04 |
| 5,125 % éch. 15/01/2029 | 3 000 | 2 336 | 0,12 | Caesars Entertainment, Inc. | | | | Comstock Resources, Inc. | | | |
| 5,125 % éch. 15/07/2029 | 4 000 | 3 117 | 0,17 | 4,625 % éch. 15/10/2029 | 8 200 | 7 407 | 0,40 | 5,875 % éch. 15/01/2030 | 3 000 | 2 606 | 0,14 |
| 5,500 % éch. 15/01/2028 | 8 000 | 6 595 | 0,35 | 7,000 % éch. 15/02/2030 | 1 300 | 1 334 | 0,07 | 6,750 % éch. 01/03/2029 | 4 075 | 3 732 | 0,20 |
| 5,500 % éch. 15/10/2029 | 2 000 | 1 571 | 0,08 | Capstone Borrower, Inc. | | | | Connect Finco SARL | | | |
| 8,125 % éch. 01/02/2027 | 3 000 | 2 768 | 0,15 | 8,000 % éch. 15/06/2030 | 2 050 | 2 135 | 0,11 | 6,750 % éch. 01/10/2026 | 2 000 | 1 990 | 0,11 |
| 11,500 % éch. 01/02/2027 (a)(g) € | 800 | 890 | 0,05 | Cargo Aircraft Management, Inc. | | | | Consolidated Communications, Inc. | | | |
| AMC Networks, Inc. | | | | 4,750 % éch. 01/02/2028 | 5 300 | 4 857 | 0,26 | 5,000 % éch. 01/10/2028 | 2 000 | 1 642 | 0,09 |
| 4,250 % éch. 15/02/2029 | \$ 6 100 | 4 660 | 0,25 | Carnival Corp. | | | | Coty, Inc. | | | |
| 4,750 % éch. 01/08/2025 | 4 900 | 4 775 | 0,26 | 4,000 % éch. 01/08/2028 | 5 000 | 4 652 | 0,25 | 5,000 % éch. 15/04/2026 | 1 045 | 1 029 | 0,06 |
| American Airlines Pass-Through Trust | | | | 5,750 % éch. 01/03/2027 | 8 900 | 8 688 | 0,46 | 6,625 % éch. 15/07/2030 | 3 700 | 3 803 | 0,20 |
| 3,375 % éch. 01/11/2028 | 2 013 | 1 847 | 0,10 | 6,000 % éch. 01/05/2029 | 2 500 | 2 407 | 0,13 | Covanta Holding Corp. | | | |
| American Airlines, Inc. | | | | 7,625 % éch. 01/03/2026 (h) | 5 000 | 5 094 | 0,27 | 4,875 % éch. 01/12/2029 | 750 | 656 | 0,04 |
| 5,500 % éch. 20/04/2026 | 5 583 | 5 547 | 0,30 | Carnival PLC | | | | 5,000 % éch. 01/09/2030 | 1 000 | 853 | 0,05 |
| 5,750 % éch. 20/04/2029 | 16 725 | 16 322 | 0,87 | 1,000 % éch. 28/10/2029 | € 5 000 | 4 020 | 0,21 | CQP Holdco LP | | | |
| Antero Resources Corp. | | | | Catalent Pharma Solutions, Inc. | | | | 5,500 % éch. 15/06/2031 | 3 500 | 3 322 | 0,18 |
| 5,375 % éch. 01/03/2030 | 700 | 672 | 0,04 | 2,375 % éch. 01/03/2028 | 2 000 | 1 929 | 0,10 | Crocs, Inc. | | | |
| API Group DE, Inc. | | | | 3,125 % éch. 15/02/2029 | \$ 6 000 | 5 257 | 0,28 | 4,250 % éch. 15/03/2029 | 2 000 | 1 794 | 0,10 |
| 4,750 % éch. 15/10/2029 | 4 000 | 3 762 | 0,20 | CCO Holdings LLC | | | | Crowdstrike Holdings, Inc. | | | |
| Arches Buyer, Inc. | | | | 4,250 % éch. 01/02/2031 | 5 000 | 4 376 | 0,23 | 3,000 % éch. 15/02/2029 | 1 800 | 1 629 | 0,09 |
| 4,250 % éch. 01/06/2028 | 3 500 | 3 173 | 0,17 | 4,250 % éch. 15/01/2034 | 3 700 | 3 012 | 0,16 | Crown Americas LLC | | | |
| | | | | 4,500 % éch. 15/08/2030 | 10 000 | 9 028 | 0,48 | 5,250 % éch. 01/04/2030 | 1 000 | 986 | 0,05 |
| | | | | 4,500 % éch. 01/05/2032 | 10 000 | 8 578 | 0,46 | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| CSC Holdings LLC | | | | Graphic Packaging International LLC | | | | Legacy LifePoint Health LLC | | | |
| 3,375 % éch. 15/02/2031 | \$ 4 000 | \$ 2 923 | 0,16 | 3,500 % éch. 01/03/2029 | \$ 5 000 | \$ 4 520 | 0,24 | 4,375 % éch. 15/02/2027 | \$ 4 900 | \$ 4 529 | 0,24 |
| 4,125 % éch. 01/12/2030 | 2 500 | 1 905 | 0,10 | Gray Television, Inc. | | | | Level 3 Financing, Inc. | | | |
| 4,500 % éch. 15/11/2031 | 1 000 | 757 | 0,04 | 5,875 % éch. 15/07/2026 | 1 000 | 974 | 0,05 | 3,750 % éch. 15/07/2029 | 5 000 | 2 600 | 0,14 |
| 6,500 % éch. 01/02/2029 | 3 000 | 2 650 | 0,14 | Grifols S.A. | | | | LifePoint Health, Inc. | | | |
| DaVita, Inc. | | | | 4,750 % éch. 15/10/2028 | 9 675 | 8 785 | 0,47 | 11,000 % éch. 15/10/2030 | 3 800 | 4 007 | 0,21 |
| 4,625 % éch. 01/06/2030 | 4 100 | 3 583 | 0,19 | GTCR W-2 Merger Sub LLC | | | | Light & Wonder International, Inc. | | | |
| Diamond Foreign Asset Co. | | | | 7,500 % éch. 15/01/2031 | 3 400 | 3 595 | 0,19 | 7,500 % éch. 01/09/2031 | 2 000 | 2 087 | 0,11 |
| 8,500 % éch. 01/10/2030 | 775 | 793 | 0,04 | Harbour Energy PLC | | | | Lindblad Expeditions Holdings, Inc. | | | |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. | | | | 5,500 % éch. 15/10/2026 | 3 800 | 3 718 | 0,20 | 9,000 % éch. 15/05/2028 | 3 000 | 3 115 | 0,17 |
| 13,000 % éch. 21/12/2026 | 77 | 75 | 0,00 | HealthEquity, Inc. | | | | Lindblad Expeditions LLC | | | |
| Diamond Sports Group LLC | | | | 4,500 % éch. 01/10/2029 | 1 800 | 1 674 | 0,09 | 6,750 % éch. 15/02/2027 | 1 900 | 1 892 | 0,10 |
| 5,375 % éch. 15/08/2026 ^ | 8 000 | 410 | 0,02 | Hertz Corp. | | | | Live Nation Entertainment, Inc. | | | |
| Directv Financing LLC | | | | 4,625 % éch. 01/12/2026 | 1 200 | 1 077 | 0,06 | 3,750 % éch. 15/01/2028 | 825 | 771 | 0,04 |
| 5,875 % éch. 15/08/2027 | 10 000 | 9 404 | 0,50 | Hilton Domestic Operating Co., Inc. | | | | Madison IAQ LLC | | | |
| DISH DBS Corp. | | | | 3,625 % éch. 15/02/2032 | 5 975 | 5 222 | 0,28 | 4,125 % éch. 30/06/2028 | 2 450 | 2 230 | 0,12 |
| 5,250 % éch. 01/12/2026 | 5 000 | 4 293 | 0,23 | 3,750 % éch. 01/05/2029 | 2 000 | 1 856 | 0,10 | MajorDrive Holdings LLC | | | |
| 5,750 % éch. 01/12/2028 | 12 800 | 10 233 | 0,55 | 4,000 % éch. 01/05/2031 | 2 000 | 1 834 | 0,10 | 6,375 % éch. 01/06/2029 | 12 475 | 10 755 | 0,57 |
| 5,875 % éch. 15/11/2024 | 5 000 | 4 693 | 0,25 | Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC | | | | Marriott Ownership Resorts, Inc. | | | |
| 7,750 % éch. 01/07/2026 | 3 000 | 2 093 | 0,11 | 4,875 % éch. 01/07/2031 | 3 000 | 2 659 | 0,14 | 4,500 % éch. 15/06/2029 | 2 350 | 2 074 | 0,11 |
| DISH Network Corp. | | | | 5,000 % éch. 01/06/2029 | 2 500 | 2 309 | 0,12 | Mauser Packaging Solutions Holding Co. | | | |
| 11,750 % éch. 15/11/2027 | 2 500 | 2 612 | 0,14 | Hologic, Inc. | | | | 7,875 % éch. 15/08/2026 | 3 500 | 3 565 | 0,19 |
| DT Midstream, Inc. | | | | 3,250 % éch. 15/02/2029 | 1 000 | 908 | 0,05 | 9,250 % éch. 15/04/2027 | 2 000 | 1 965 | 0,11 |
| 4,125 % éch. 15/06/2029 | 4 000 | 3 685 | 0,20 | Howard Midstream Energy Partners LLC | | | | McAfee Corp. | | | |
| 4,375 % éch. 15/06/2031 | 1 700 | 1 536 | 0,08 | 6,750 % éch. 15/01/2027 | 3 000 | 2 970 | 0,16 | 7,375 % éch. 15/02/2030 | 4 000 | 3 658 | 0,20 |
| Edgewell Personal Care Co. | | | | 8,875 % éch. 15/07/2028 | 2 825 | 2 968 | 0,16 | Medline Borrower LP | | | |
| 4,125 % éch. 01/04/2029 | 800 | 729 | 0,04 | Howmet Aerospace, Inc. | | | | 3,875 % éch. 01/04/2029 | 10 925 | 9 891 | 0,53 |
| Element Solutions, Inc. | | | | 5,950 % éch. 01/02/2037 | 2 000 | 2 090 | 0,11 | 5,250 % éch. 01/10/2029 | 3 800 | 3 587 | 0,19 |
| 3,875 % éch. 01/09/2028 | 1 200 | 1 106 | 0,06 | iHeartCommunications, Inc. | | | | Merlin Entertainments Ltd. | | | |
| Embecta Corp. | | | | 4,750 % éch. 15/01/2028 | 2 100 | 1 617 | 0,09 | 5,750 % éch. 15/06/2026 | 2 000 | 1 981 | 0,11 |
| 5,000 % éch. 15/02/2030 (h) | 4 300 | 3 653 | 0,20 | 8,375 % éch. 01/05/2027 | 2 200 | 1 430 | 0,08 | Midwest Gaming Borrower LLC | | | |
| Emerald Debt Merger Sub LLC | | | | IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature) | | | | 4,875 % éch. 01/05/2029 | 5 000 | 4 656 | 0,25 |
| 6,625 % éch. 15/12/2030 | 3 800 | 3 886 | 0,21 | 4,750 % éch. 15/09/2026 (b) | 2 000 | 1 918 | 0,10 | Molina Healthcare, Inc. | | | |
| EnLink Midstream LLC | | | | IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % en numéraire ou 6,750 % de rémunération en nature) | | | | 3,875 % éch. 15/05/2032 | 1 900 | 1 662 | 0,09 |
| 5,625 % éch. 15/01/2028 | 5 000 | 4 948 | 0,26 | 6,000 % éch. 15/05/2027 (b) | 2 000 | 1 951 | 0,10 | MPH Acquisition Holdings LLC | | | |
| 6,500 % éch. 01/09/2030 | 3 500 | 3 577 | 0,19 | IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % en numéraire ou 7,125 % de rémunération en nature) | | | | 5,500 % éch. 01/09/2028 | 4 247 | 3 808 | 0,20 |
| EnLink Midstream Partners LP | | | | 6,375 % éch. 15/05/2029 (b) | 1 750 | 1 719 | 0,09 | 5,750 % éch. 01/11/2028 (h) | 5 000 | 4 068 | 0,22 |
| 4,150 % éch. 01/06/2025 | 1 987 | 1 944 | 0,10 | Imola Merger Corp. | | | | Murphy Oil USA, Inc. | | | |
| EQM Midstream Partners LP | | | | 4,750 % éch. 15/05/2029 | 5 000 | 4 757 | 0,25 | 3,750 % éch. 15/02/2031 | 1 000 | 872 | 0,05 |
| 4,000 % éch. 01/08/2024 | 1 123 | 1 113 | 0,06 | Ingevity Corp. | | | | Nabors Industries, Inc. | | | |
| 4,500 % éch. 15/01/2029 | 7 700 | 7 281 | 0,39 | 3,875 % éch. 01/11/2028 | 5 000 | 4 484 | 0,24 | 7,375 % éch. 15/05/2027 | 3 000 | 2 942 | 0,16 |
| 4,750 % éch. 15/01/2031 | 4 650 | 4 334 | 0,23 | Innophos Holdings, Inc. | | | | 9,125 % éch. 31/01/2030 | 500 | 502 | 0,03 |
| 6,000 % éch. 01/07/2025 | 735 | 735 | 0,04 | 9,375 % éch. 15/02/2028 | 7 200 | 6 546 | 0,35 | NCL Corp. Ltd. | | | |
| 6,500 % éch. 01/07/2027 | 4 000 | 4 075 | 0,22 | Intelligent Packaging Holdco Issuer LP (9,000 % en numéraire ou 9,750 % de rémunération en nature) | | | | 5,875 % éch. 15/03/2026 | 4 800 | 4 694 | 0,25 |
| 6,500 % éch. 15/07/2048 | 3 800 | 3 899 | 0,21 | 9,000 % éch. 15/01/2026 (b) | 3 000 | 2 581 | 0,14 | 5,875 % éch. 15/02/2027 | 1 775 | 1 761 | 0,09 |
| Fertitta Entertainment LLC | | | | Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc. | | | | NCR Atleo Corp. | | | |
| 4,625 % éch. 15/01/2029 | 2 000 | 1 816 | 0,10 | 6,000 % éch. 15/09/2028 | 4 000 | 3 736 | 0,20 | 9,500 % éch. 01/04/2029 | 6 575 | 6 992 | 0,37 |
| First Student Bidco, Inc. | | | | Intelsat Jackson Holdings S.A. | | | | NCR Voyix Corp. | | | |
| 4,000 % éch. 31/07/2029 | 3 000 | 2 604 | 0,14 | 6,500 % éch. 15/03/2030 | 11 249 | 10 744 | 0,57 | 5,000 % éch. 01/10/2028 | 950 | 899 | 0,05 |
| Ford Motor Co. | | | | Iris Holdings, Inc. (8,750 % en numéraire ou 9,500 % de rémunération en nature) | | | | 5,125 % éch. 15/04/2029 | 2 200 | 2 094 | 0,11 |
| 6,100 % éch. 19/08/2032 | 2 500 | 2 521 | 0,13 | 8,750 % éch. 15/02/2026 (b) | 2 875 | 2 444 | 0,13 | 5,250 % éch. 01/10/2030 | 1 200 | 1 104 | 0,06 |
| Fortrea Holdings, Inc. | | | | Jazz Securities DAC | | | | NESCO Holdings, Inc. | | | |
| 7,500 % éch. 01/07/2030 | 2 500 | 2 571 | 0,14 | 4,375 % éch. 15/01/2029 | 1 000 | 932 | 0,05 | 5,500 % éch. 15/04/2029 | 2 250 | 2 083 | 0,11 |
| Foundation Building Materials, Inc. | | | | Jeld-Wen, Inc. | | | | Newell Brands, Inc. | | | |
| 6,000 % éch. 01/03/2029 | 11 000 | 9 902 | 0,53 | 4,625 % éch. 15/12/2025 | 750 | 726 | 0,04 | 6,375 % éch. 15/09/2027 (h) | 1 250 | 1 245 | 0,07 |
| Frontier Communications Holdings LLC | | | | 4,875 % éch. 15/12/2027 | 200 | 189 | 0,01 | 6,375 % éch. 01/04/2036 | 300 | 275 | 0,01 |
| 5,000 % éch. 01/05/2028 | 2 000 | 1 850 | 0,10 | Kaiser Aluminum Corp. | | | | Newfold Digital Holdings Group, Inc. | | | |
| 5,875 % éch. 15/10/2027 | 3 000 | 2 901 | 0,16 | 4,500 % éch. 01/06/2031 | 1 000 | 864 | 0,05 | 6,000 % éch. 15/02/2029 | 12 000 | 9 078 | 0,48 |
| Gap, Inc. | | | | 4,625 % éch. 01/03/2028 | 800 | 741 | 0,04 | Nexstar Media, Inc. | | | |
| 3,625 % éch. 01/10/2029 | 9 300 | 7 963 | 0,43 | Kinetik Holdings LP | | | | 5,625 % éch. 15/07/2027 | 1 000 | 968 | 0,05 |
| 3,875 % éch. 01/10/2031 | 2 800 | 2 310 | 0,12 | 6,625 % éch. 15/12/2028 | 3 000 | 3 058 | 0,16 | NextEra Energy Operating Partners LP | | | |
| Garda World Security Corp. | | | | LABL, Inc. | | | | 3,875 % éch. 15/10/2026 | 200 | 191 | 0,01 |
| 4,625 % éch. 15/02/2027 | 4 500 | 4 342 | 0,23 | 5,875 % éch. 01/11/2028 | 4 825 | 4 381 | 0,23 | 4,500 % éch. 15/09/2027 | 2 925 | 2 818 | 0,15 |
| 6,000 % éch. 01/06/2029 | 5 000 | 4 487 | 0,24 | 6,750 % éch. 15/07/2026 | 2 000 | 1 947 | 0,10 | 7,250 % éch. 15/01/2029 | 4 400 | 4 609 | 0,25 |
| 7,750 % éch. 15/02/2028 | 6 000 | 6 214 | 0,33 | 8,250 % éch. 01/11/2029 | 1 000 | 844 | 0,05 | Noble Finance LLC | | | |
| GFL Environmental, Inc. | | | | 10,500 % éch. 15/07/2027 | 2 000 | 1 920 | 0,10 | 8,000 % éch. 15/04/2030 | 5 600 | 5 832 | 0,31 |
| 3,500 % éch. 01/09/2028 | 5 000 | 4 625 | 0,25 | Lamar Media Corp. | | | | Novellis Corp. | | | |
| 4,000 % éch. 01/08/2028 | 5 000 | 4 625 | 0,25 | 3,625 % éch. 15/01/2031 | 275 | 245 | 0,01 | 3,250 % éch. 15/11/2026 | 3 000 | 2 826 | 0,15 |
| 5,125 % éch. 15/12/2026 | 1 000 | 990 | 0,05 | Lamb Weston Holdings, Inc. | | | | 3,875 % éch. 15/08/2031 | 7 000 | 6 179 | 0,33 |
| GN Bondco LLC | | | | 4,125 % éch. 31/01/2030 | 3 000 | 2 769 | 0,15 | 4,750 % éch. 30/01/2030 | 5 000 | 4 710 | 0,25 |
| 9,500 % éch. 15/10/2031 | 6 200 | 6 061 | 0,32 | 4,375 % éch. 31/01/2032 | 1 000 | 914 | 0,05 | NuStar Logistics LP | | | |
| Go Daddy Operating Co. LLC | | | | 4,875 % éch. 15/05/2028 | 2 000 | 1 958 | 0,10 | 5,750 % éch. 01/10/2025 | 2 000 | 1 989 | 0,11 |
| 3,500 % éch. 01/03/2029 | 5 000 | 4 534 | 0,24 | Las Vegas Sands Corp. | | | | 6,375 % éch. 01/10/2030 | 1 300 | 1 304 | 0,07 |
| goeasy Ltd. | | | | 3,900 % éch. 08/08/2029 | 15 275 | 14 094 | 0,75 | Olympus Water U.S. Holding Corp. | | | |
| 9,250 % éch. 01/12/2028 | 6 600 | 7 054 | 0,38 | | | | | 3,875 % éch. 01/10/2028 | € 1 000 | 1 016 | 0,05 |
| Graham Packaging Co., Inc. | | | | | | | | 4,250 % éch. 01/10/2028 | \$ 7 000 | 6 307 | 0,34 |
| 7,125 % éch. 15/08/2028 | 6 700 | 6 038 | 0,32 | | | | | | | | |

Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 5,375 % éch. 01/10/2029 (h) | € 8 000 | \$ 7 586 | 0,41 | Seadrill Finance Ltd. | | | | 5,500 % éch. 15/11/2027 | \$ 7 000 | \$ 6 864 | 0,37 |
| 6,250 % éch. 01/10/2029 | \$ 2 000 | 1 779 | 0,10 | 8,375 % éch. 01/08/2030 | \$ 3 500 | \$ 3 655 | 0,20 | 6,250 % éch. 15/03/2026 | 1 750 | 1 749 | 0,09 |
| ON Semiconductor Corp. | | | | Seagate HDD Cayman | | | | 6,750 % éch. 15/08/2028 | 5 000 | 5 122 | 0,27 |
| 3,875 % éch. 01/09/2028 | 4 275 | 3 969 | 0,21 | 5,750 % éch. 01/12/2034 | 1 800 | 1 732 | 0,09 | 6,875 % éch. 15/12/2030 | 1 800 | 1 855 | 0,10 |
| Organon & Co. | | | | 8,250 % éch. 15/12/2029 | 1 150 | 1 241 | 0,07 | 7,125 % éch. 01/12/2031 | 700 | 734 | 0,04 |
| 4,125 % éch. 30/04/2028 | 6 800 | 6 265 | 0,33 | 8,500 % éch. 15/07/2031 | 1 175 | 1 276 | 0,07 | Transocean Titan Financing Ltd. | | | |
| 5,125 % éch. 30/04/2031 | 10 400 | 8 907 | 0,48 | 9,625 % éch. 01/12/2032 | 2 000 | 2 288 | 0,12 | 8,375 % éch. 01/02/2028 | 4 000 | 4 153 | 0,22 |
| Outfront Media Capital LLC | | | | Sealed Air Corp. | | | | Transocean, Inc. | | | |
| 4,250 % éch. 15/01/2029 | 2 000 | 1 807 | 0,10 | 7,250 % éch. 15/02/2031 | 1 505 | 1 598 | 0,09 | 8,750 % éch. 15/02/2030 | 1 900 | 1 987 | 0,11 |
| 5,000 % éch. 15/08/2027 | 2 125 | 2 056 | 0,11 | Sensata Technologies BV | | | | Travel + Leisure Co. | | | |
| Owens-Brockway Glass Container, Inc. | | | | 4,000 % éch. 15/04/2029 | 5 000 | 4 652 | 0,25 | 4,625 % éch. 01/03/2030 | 5 000 | 4 478 | 0,24 |
| 7,250 % éch. 15/05/2031 | 3 000 | 3 045 | 0,16 | Sensata Technologies, Inc. | | | | 6,000 % éch. 01/04/2027 | 25 | 25 | 0,00 |
| Pactiv Evergreen Group Issuer LLC | | | | 3,750 % éch. 15/02/2031 | 5 000 | 4 414 | 0,24 | 6,625 % éch. 31/07/2026 | 3 500 | 3 534 | 0,19 |
| 4,375 % éch. 15/10/2028 | 3 000 | 2 808 | 0,15 | Simmons Foods, Inc. | | | | Trident TPI Holdings, Inc. | | | |
| Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. | | | | 4,625 % éch. 01/03/2029 | 8 000 | 6 929 | 0,37 | 12,750 % éch. 31/12/2028 | 9 750 | 10 445 | 0,56 |
| 4,000 % éch. 15/10/2027 | 5 000 | 4 678 | 0,25 | Sirius XM Radio, Inc. | | | | TriNet Group, Inc. | | | |
| Performance Food Group, Inc. | | | | 3,875 % éch. 01/09/2031 | 2 000 | 1 713 | 0,09 | 3,500 % éch. 01/03/2029 | 5 000 | 4 479 | 0,24 |
| 4,250 % éch. 01/08/2029 | 3 000 | 2 755 | 0,15 | 4,125 % éch. 01/07/2030 | 3 250 | 2 900 | 0,15 | Triton Water Holdings, Inc. | | | |
| 6,875 % éch. 01/05/2025 | 1 000 | 1 004 | 0,05 | 5,000 % éch. 01/08/2027 | 2 000 | 1 933 | 0,10 | 6,250 % éch. 01/04/2029 | 3 000 | 2 616 | 0,14 |
| Permian Resources Operating LLC | | | | SM Energy Co. | | | | Triumph Group, Inc. | | | |
| 5,375 % éch. 15/01/2026 | 5 000 | 4 938 | 0,26 | 6,500 % éch. 15/07/2028 | 800 | 801 | 0,04 | 7,750 % éch. 15/08/2025 | 4 000 | 3 990 | 0,21 |
| 7,000 % éch. 15/01/2032 | 1 800 | 1 858 | 0,10 | Southwestern Energy Co. | | | | 9,000 % éch. 15/03/2028 | 6 950 | 7 399 | 0,40 |
| PetSmart, Inc. | | | | 4,750 % éch. 01/02/2032 | 200 | 185 | 0,01 | Twilio, Inc. | | | |
| 4,750 % éch. 15/02/2028 | 6 000 | 5 661 | 0,30 | 5,375 % éch. 01/02/2029 | 1 800 | 1 758 | 0,09 | 3,625 % éch. 15/03/2029 | 3 000 | 2 740 | 0,15 |
| Post Holdings, Inc. | | | | 5,375 % éch. 15/03/2030 | 2 200 | 2 151 | 0,12 | 3,875 % éch. 31/07/2026 | 3 500 | 3 124 | 0,17 |
| 4,500 % éch. 15/09/2031 | 2 779 | 2 494 | 0,13 | Spectrum Brands, Inc. | | | | U.S. Acute Care Solutions LLC | | | |
| 4,625 % éch. 15/04/2030 | 9 000 | 8 288 | 0,44 | 3,875 % éch. 15/03/2031 | 3 100 | 2 825 | 0,15 | 6,375 % éch. 01/03/2026 | 6 000 | 5 020 | 0,27 |
| 5,625 % éch. 15/01/2028 | 4 975 | 4 934 | 0,26 | 5,500 % éch. 15/07/2030 | 2 200 | 2 137 | 0,11 | U.S. Foods, Inc. | | | |
| Presidio Holdings, Inc. | | | | Spirit AeroSystems, Inc. | | | | 4,750 % éch. 15/02/2029 | 7 000 | 6 654 | 0,36 |
| 4,875 % éch. 01/02/2027 | 2 500 | 2 453 | 0,13 | 4,600 % éch. 15/06/2028 | 6 275 | 5 557 | 0,30 | 7,250 % éch. 15/01/2032 | 900 | 940 | 0,05 |
| 8,250 % éch. 01/02/2028 | 3 750 | 3 792 | 0,20 | 9,375 % éch. 30/11/2029 | 3 000 | 3 287 | 0,18 | Uber Technologies, Inc. | | | |
| Prestige Brands, Inc. | | | | 9,750 % éch. 15/11/2030 | 900 | 969 | 0,05 | 4,500 % éch. 15/08/2029 | 4 000 | 3 823 | 0,20 |
| 3,750 % éch. 01/04/2031 | 50 | 44 | 0,00 | Spirit Loyalty Cayman Ltd. | | | | United Airlines, Inc. | | | |
| Prime Security Services Borrower LLC | | | | 8,000 % éch. 20/09/2025 | 4 600 | 3 313 | 0,18 | 4,375 % éch. 15/04/2026 | 4 975 | 4 852 | 0,26 |
| 3,375 % éch. 31/08/2027 | 2 000 | 1 856 | 0,10 | SRS Distribution, Inc. | | | | 4,625 % éch. 15/04/2029 | 9 700 | 9 082 | 0,49 |
| 5,750 % éch. 15/04/2026 | 1 000 | 1 006 | 0,05 | 6,125 % éch. 01/07/2029 | 4 300 | 4 082 | 0,22 | Univision Communications, Inc. | | | |
| 6,250 % éch. 15/01/2028 | 5 000 | 4 975 | 0,27 | Stagwell Global LLC | | | | 4,500 % éch. 01/05/2029 | 7 000 | 6 254 | 0,33 |
| PTC, Inc. | | | | 5,625 % éch. 15/08/2029 | 1 000 | 921 | 0,05 | 6,625 % éch. 01/06/2027 | 2 000 | 1 996 | 0,11 |
| 4,000 % éch. 15/02/2028 | 1 550 | 1 470 | 0,08 | Standard Industries, Inc. | | | | 8,000 % éch. 15/08/2028 | 3 050 | 3 149 | 0,17 |
| Raising Cane's Restaurants LLC | | | | 3,375 % éch. 15/01/2031 | 4 000 | 3 447 | 0,18 | UPC Holding BV | | | |
| 9,375 % éch. 01/05/2029 | 1 025 | 1 095 | 0,06 | 4,375 % éch. 15/07/2030 | 2 500 | 2 299 | 0,12 | 5,500 % éch. 15/01/2028 | 3 000 | 2 831 | 0,15 |
| Resorts World Las Vegas LLC | | | | 4,750 % éch. 15/01/2028 | 3 500 | 3 372 | 0,18 | Valaris Ltd. | | | |
| 4,625 % éch. 16/04/2029 | 250 | 218 | 0,01 | 5,000 % éch. 15/02/2027 | 1 500 | 1 464 | 0,08 | 8,375 % éch. 30/04/2030 | 6 925 | 7 101 | 0,38 |
| 8,450 % éch. 27/07/2030 | 2 275 | 2 348 | 0,13 | Star Parent, Inc. | | | | Venture Global Calcasieu Pass LLC | | | |
| Ritchie Bros Holdings, Inc. | | | | 9,000 % éch. 01/10/2030 | 600 | 633 | 0,03 | 3,875 % éch. 15/08/2029 | 5 000 | 4 542 | 0,24 |
| 6,750 % éch. 15/03/2028 | 1 250 | 1 289 | 0,07 | Station Casinos LLC | | | | 4,125 % éch. 15/08/2031 | 3 000 | 2 647 | 0,14 |
| 7,750 % éch. 15/03/2031 | 2 000 | 2 135 | 0,11 | 4,500 % éch. 15/02/2028 | 2 800 | 2 642 | 0,14 | Venture Global LNG, Inc. | | | |
| Rockcliff Energy LLC | | | | 4,625 % éch. 01/12/2031 | 1 900 | 1 715 | 0,09 | 8,125 % éch. 01/06/2028 | 6 000 | 6 065 | 0,32 |
| 5,500 % éch. 15/10/2029 | 6 000 | 5 679 | 0,30 | Strathcona Resources Ltd. | | | | 8,375 % éch. 01/06/2031 | 10 800 | 10 811 | 0,58 |
| Rockies Express Pipeline LLC | | | | 6,875 % éch. 01/08/2026 | 4 625 | 4 420 | 0,24 | 9,500 % éch. 01/02/2029 | 3 200 | 3 388 | 0,18 |
| 4,800 % éch. 15/05/2030 | 2 000 | 1 833 | 0,10 | Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP | | | | 9,875 % éch. 01/02/2032 | 1 600 | 1 668 | 0,09 |
| 4,950 % éch. 15/07/2029 | 2 000 | 1 915 | 0,10 | Tapestry, Inc. | | | | Vertiv Group Corp. | | | |
| Roller Bearing Co. of America, Inc. | | | | 7,700 % éch. 27/11/2030 | 3 525 | 3 714 | 0,20 | 4,125 % éch. 15/11/2028 | 7 000 | 6 572 | 0,35 |
| 4,375 % éch. 15/10/2029 | 3 000 | 2 780 | 0,15 | TEGNA, Inc. | | | | ViaSat, Inc. | | | |
| Rolls-Royce PLC | | | | 4,625 % éch. 15/03/2028 | 1 000 | 935 | 0,05 | 5,625 % éch. 15/09/2025 | 1 700 | 1 659 | 0,09 |
| 3,625 % éch. 14/10/2025 | 1 000 | 964 | 0,05 | 4,750 % éch. 15/03/2026 | 1 000 | 973 | 0,05 | 5,625 % éch. 15/04/2027 | 1 800 | 1 743 | 0,09 |
| 5,750 % éch. 15/10/2027 | £ 1 750 | 2 245 | 0,12 | 5,000 % éch. 15/09/2029 | 4 000 | 3 670 | 0,20 | 6,500 % éch. 15/07/2028 | 2 000 | 1 645 | 0,09 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. | | | | Teleflex, Inc. | | | | Victoria's Secret & Co. | | | |
| 4,250 % éch. 01/07/2026 | \$ 5 000 | 4 832 | 0,26 | 4,250 % éch. 01/06/2028 | 800 | 759 | 0,04 | 4,625 % éch. 15/07/2029 | 2 000 | 1 673 | 0,09 |
| 5,375 % éch. 15/07/2027 | 3 000 | 2 972 | 0,16 | Tenet Healthcare Corp. | | | | Viking Cruises Ltd. | | | |
| 5,500 % éch. 31/08/2026 | 10 000 | 9 908 | 0,53 | 4,375 % éch. 15/01/2030 | 4 000 | 3 711 | 0,20 | 5,875 % éch. 15/09/2027 | 5 000 | 4 829 | 0,26 |
| 5,500 % éch. 01/04/2028 | 7 100 | 7 014 | 0,37 | 5,125 % éch. 01/11/2027 | 3 500 | 3 424 | 0,18 | 7,000 % éch. 15/02/2029 | 4 000 | 3 970 | 0,21 |
| 7,250 % éch. 15/01/2030 | 2 000 | 2 090 | 0,11 | 6,125 % éch. 01/10/2028 | 9 200 | 9 182 | 0,49 | 9,125 % éch. 15/07/2031 | 3 000 | 3 199 | 0,17 |
| 7,500 % éch. 15/10/2027 | 700 | 737 | 0,04 | 6,125 % éch. 15/06/2030 | 5 000 | 5 062 | 0,27 | Virgin Media Secured Finance PLC | | | |
| 9,250 % éch. 15/01/2029 | 1 000 | 1 076 | 0,06 | 6,875 % éch. 15/11/2031 | 3 200 | 3 290 | 0,18 | 4,500 % éch. 15/08/2030 | 5 000 | 4 458 | 0,24 |
| Sabre GBLB, Inc. | | | | Thor Industries, Inc. | | | | 5,500 % éch. 15/05/2029 | 4 000 | 3 869 | 0,21 |
| 8,625 % éch. 01/06/2027 | 1 983 | 1 806 | 0,10 | 4,000 % éch. 15/10/2029 | 700 | 625 | 0,03 | Vital Energy, Inc. | | | |
| 11,250 % éch. 15/12/2027 | 800 | 787 | 0,04 | TK Elevator Holdco GmbH | | | | 9,750 % éch. 15/10/2030 | 675 | 700 | 0,04 |
| Scientific Games Holdings LP | | | | 7,625 % éch. 15/07/2028 | 4 734 | 4 656 | 0,25 | Vmed O2 UK Financing PLC | | | |
| 6,625 % éch. 01/03/2030 | 7 000 | 6 626 | 0,35 | TK Elevator U.S. Newco, Inc. | | | | 4,250 % éch. 31/01/2031 | 5 000 | 4 372 | 0,23 |
| SCIH Salt Holdings, Inc. | | | | 5,250 % éch. 15/07/2027 | 3 500 | 3 441 | 0,18 | VOC Escrow Ltd. | | | |
| 4,875 % éch. 01/05/2028 | 3 000 | 2 810 | 0,15 | TopBuild Corp. | | | | 5,000 % éch. 15/02/2028 | 2 000 | 1 917 | 0,10 |
| Scotts Miracle-Gro Co. | | | | 4,125 % éch. 15/02/2032 | 900 | 802 | 0,04 | WESCO Distribution, Inc. | | | |
| 4,375 % éch. 01/02/2032 | 4 025 | 3 406 | 0,18 | TransDigm, Inc. | | | | 7,125 % éch. 15/06/2025 | 3 000 | 3 024 | 0,16 |
| Scripps Escrow, Inc. | | | | 4,625 % éch. 15/01/2029 | 17 400 | 16 347 | 0,87 | White Cap Buyer LLC | | | |
| 5,375 % éch. 15/01/2031 | 3 800 | 2 793 | 0,15 | 4,875 % éch. 01/05/2029 | 800 | 749 | 0,04 | 6,875 % éch. 15/10/2028 | 7 200 | 6 979 | 0,37 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-----------|----------------------------------|------------------------------|
| White Cap Parent LLC (8,250 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) | | | | FirstEnergy Corp. | | | | ACTIONS ORDINAIRES | | | |
| 8,250 % éch. 15/03/2026 (b) | \$ 5 250 | \$ 5 232 | 0,28 | 3,400 % éch. 01/03/2050 | \$ 1 000 | \$ 706 | 0,04 | SERVICES DE COMMUNICATION | | | |
| Williams Scotsman, Inc. | | | | Genesis Energy LP | | | | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c) | 167 378 | \$ 305 | 0,02 |
| 4,625 % éch. 15/08/2028 | 2 750 | 2 600 | 0,14 | 7,750 % éch. 01/02/2028 | 2 000 | 2 009 | 0,11 | iHeartMedia, Inc. « B » (c) | 29 972 | 72 | 0,00 |
| 7,375 % éch. 01/10/2031 | 800 | 839 | 0,04 | 8,000 % éch. 15/01/2027 | 3 000 | 3 052 | 0,16 | Intelsat Emergence S.A. (c)(g) | 152 416 | 4 342 | 0,23 |
| WMG Acquisition Corp. | | | | High Ridge Brands Co. | | | | | | 4 719 | 0,25 |
| 3,000 % éch. 15/02/2031 | 4 150 | 3 561 | 0,19 | 8,875 % éch. 15/03/2025 ^ | 2 500 | 41 | 0,00 | ÉNERGIE | | | |
| 3,875 % éch. 15/07/2030 | 3 000 | 2 717 | 0,15 | NGL Energy Operating LLC | | | | CHC Group LLC (c) | 3 887 | 0 | 0,00 |
| WR Grace Holdings LLC | | | | 7,500 % éch. 01/02/2026 | 3 975 | 4 018 | 0,21 | SERVICES FINANCIERS | | | |
| 4,875 % éch. 15/06/2027 | 1 000 | 963 | 0,05 | NSG Holdings LLC | | | | Voyager Aviation Holdings LLC (c) | 833 | 0 | 0,00 |
| Wyndham Hotels & Resorts, Inc. | | | | 7,750 % éch. 15/12/2025 | 146 | 146 | 0,01 | INDUSTRIE | | | |
| 4,375 % éch. 15/08/2028 | 3 000 | 2 807 | 0,15 | PBF Holding Co. LLC | | | | Serta Simmons Bedding LLC (c)(g) | 1 852 | 23 | 0,00 |
| Wynn Las Vegas LLC | | | | 6,000 % éch. 15/02/2028 | 1 000 | 975 | 0,05 | | | 4 742 | 0,25 |
| 5,250 % éch. 15/05/2027 | 3 000 | 2 922 | 0,16 | 7,875 % éch. 15/09/2030 | 1 125 | 1 147 | 0,06 | BONS DE SOUSCRIPTION | | | |
| 5,500 % éch. 01/03/2025 | 1 245 | 1 239 | 0,07 | Tallgrass Energy Partners LP | | | | Revlon Group Holdings LLC - 28/04/2028 | 30 870 | 0 | 0,00 |
| Wynn Resorts Finance LLC | | | | 5,500 % éch. 15/01/2028 | 1 750 | 1 656 | 0,09 | TITRES PRIVILÉGIÉS | | | |
| 5,125 % éch. 01/10/2029 | 3 000 | 2 835 | 0,15 | 6,000 % éch. 31/12/2030 | 2 000 | 1 862 | 0,10 | Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 % | 5 000 | 0 | 0,00 |
| XPO, Inc. | | | | 7,500 % éch. 01/10/2025 | 1 000 | 1 006 | 0,05 | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 7,125 % éch. 01/06/2031 | 2 000 | 2 073 | 0,11 | Telecom Italia Capital S.A. | | | | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e) | 661 211 | 6 110 | 0,33 |
| Yum! Brands, Inc. | | | | 6,375 % éch. 15/11/2033 | 2 500 | 2 449 | 0,13 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (e) | 1 743 573 | 21 783 | 1,16 |
| 3,625 % éch. 15/03/2031 | 2 975 | 2 686 | 0,14 | 7,200 % éch. 18/07/2036 | 2 500 | 2 513 | 0,13 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e) | 4 640 942 | 46 245 | 2,47 |
| 4,625 % éch. 31/01/2032 | 5 000 | 4 681 | 0,25 | 7,721 % éch. 04/06/2038 | 1 000 | 1 020 | 0,05 | Total des Valeurs mobilières | | \$ 1 770 912 | 94,55 |
| 4,750 % éch. 15/01/2030 | 2 000 | 1 941 | 0,10 | Telecom Italia SpA | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 6,875 % éch. 15/11/2037 | 2 000 | 2 198 | 0,12 | 7,875 % éch. 31/07/2028 | € 11 400 | 14 026 | 0,75 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e) | | | |
| Zayo Group Holdings, Inc. | | | | TerraForm Power Operating LLC | | | | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (e) | | | |
| 4,000 % éch. 01/03/2027 | 2 500 | 2 007 | 0,11 | 4,750 % éch. 15/01/2030 | \$ 2 000 | 1 862 | 0,10 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e) | | | |
| ZF North America Capital, Inc. | | | | 5,000 % éch. 31/01/2028 | 2 000 | 1 944 | 0,10 | Total des Fonds d'investissement | | \$ 74 138 | 3,96 |
| 6,875 % éch. 14/04/2028 | 550 | 570 | 0,03 | Vistra Operations Co. LLC | | | | | | | |
| 7,125 % éch. 14/04/2030 | 1 450 | 1 547 | 0,08 | 5,000 % éch. 31/07/2027 | 650 | 633 | 0,03 | | | | |
| Ziggo BV | | | | 7,750 % éch. 15/10/2031 | 5 000 | 5 197 | 0,28 | | | | |
| 4,875 % éch. 15/01/2030 | 5 100 | 4 555 | 0,24 | | | 84 643 | 4,52 | | | | |
| ZipRecruiter, Inc. | | | | Total Obligations et billets privés | | 1 671 373 | 89,24 | | | | |
| 5,000 % éch. 15/01/2030 | 900 | 787 | 0,04 | OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN | | | | | | | |
| | | 1 427 639 | 76,23 | Billets du Trésor américain | | | | | | | |
| | | | | 4,250 % éch. 15/10/2025 | 50 000 | 49 913 | 2,66 | | | | |
| SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | | | | TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | |
| Antero Midstream Partners LP | | | | Countrywide Alternative Loan Trust | | | | | | | |
| 5,375 % éch. 15/06/2029 | 2 500 | 2 406 | 0,13 | 5,932 % éch. 20/05/2046 | 53 | 45 | 0,01 | | | | |
| 5,750 % éch. 01/03/2027 | 2 500 | 2 482 | 0,13 | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | | | | |
| Blue Racer Midstream LLC | | | | 6,170 % éch. 25/02/2036 | 1 | 0 | 0,00 | | | | |
| 6,625 % éch. 15/07/2026 | 2 000 | 1 990 | 0,11 | Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust | | | | | | | |
| 7,625 % éch. 15/12/2025 | 1 100 | 1 115 | 0,06 | 5,500 % éch. 25/12/2035 | 38 | 31 | 0,00 | | | | |
| Calpine Corp. | | | | GSR Mortgage Loan Trust | | | | | | | |
| 3,750 % éch. 01/03/2031 | 10 000 | 8 783 | 0,47 | 5,939 % éch. 25/04/2035 | 1 | 1 | 0,00 | | | | |
| 4,500 % éch. 15/02/2028 | 2 500 | 2 379 | 0,13 | MortgageIT Trust | | | | | | | |
| 5,000 % éch. 01/02/2031 | 2 300 | 2 111 | 0,11 | 6,110 % éch. 25/02/2035 | 26 | 25 | 0,00 | | | | |
| 5,125 % éch. 15/03/2028 | 4 200 | 4 029 | 0,22 | | | 102 | 0,01 | | | | |
| Clearway Energy Operating LLC | | | | TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS | | | | | | | |
| 3,750 % éch. 15/02/2031 | 4 600 | 4 057 | 0,22 | Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust | | | | | | | |
| CrownRock LP | | | | 3,311 % éch. 25/01/2037 | 76 | 24 | 0,00 | | | | |
| Edison International | | | | | | | | | | | |
| 8,125 % éch. 15/06/2053 | 1 000 | 1 023 | 0,06 | | | | | | | | |
| Endeavor Energy Resources LP | | | | | | | | | | | |
| 5,750 % éch. 30/01/2028 | 5 000 | 5 008 | 0,27 | | | | | | | | |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance du principal | Montant | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|--------------|-------------------|------------------------------|---------|-----------------------------|------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 912 | Billets du Trésor américain | \$ (930) | \$ 912 | \$ 912 | 0,05 |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (930) | \$ 912 | \$ 912 | 0,05 |

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 204 | \$ (934) | (0,05) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Long | 03/2024 | 528 | 1 134 | 0,06 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Court | 03/2024 | 1 027 | (2 419) | (0,13) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Long | 03/2024 | 214 | 1 071 | 0,06 |
| | | | | \$ (1 148) | (0,06) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (1 148) | (0,06) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|----------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 % | 20/06/2028 | € 9 600 | \$ 776 | 0,04 |
| Newell Brands, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | \$ 2 275 | 129 | 0,01 |
| | | | | \$ 905 | 0,05 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.HY-40 Index à 5 ans | 5,000 % | 20/06/2028 | \$ 99 | \$ 5 | 0,00 |
| Indice CDX.HY-41 Index à 5 ans | 5,000 | 20/12/2028 | 90 981 | 5 101 | 0,27 |
| | | | | \$ 5 106 | 0,27 |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | \$ 6 011 | 0,32 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 2 952 | \$ 3 224 | \$ 2 | \$ (40) | \$ (38) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 186 | 236 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | \$ 5 430 | € 4 959 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 1 299 | \$ 960 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 269 | 293 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | 66 484 | 73 076 | 1 | (383) | (382) | (0,02) |
| MYI | 01/2024 | \$ 3 315 | € 3 029 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 01/2024 | 42 | £ 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | £ 1 062 | \$ 1 344 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | | | | \$ 84 | \$ (464) | \$ (380) | (0,02) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 402 | \$ 437 | \$ 0 | \$ (7) | \$ (7) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 19 777 | € 18 120 | 246 | (2) | 244 | 0,01 |
| BRC | 01/2024 | 102 372 | 93 084 | 477 | 0 | 477 | 0,02 |
| CBK | 01/2024 | € 18 632 | \$ 20 323 | (1) | (264) | (265) | (0,01) |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | \$ 51 | € 47 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 15 943 | \$ 17 209 | 0 | (407) | (407) | (0,02) |
| | 01/2024 | \$ 59 | € 54 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 114 579 | 104 246 | 603 | 0 | 603 | 0,03 |
| UAG | 01/2024 | 114 667 | 104 246 | 515 | 0 | 515 | 0,03 |
| | | | | \$ 1 842 | \$ (680) | \$ 1 162 | 0,06 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|---|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 2 718 | £ 2 146 | \$ 17 | \$ 0 | \$ 17 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 115 | \$ 145 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 299 | £ 1 812 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 38 | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 24 | \$ 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ 26 | £ 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | £ 35 | \$ 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 118 | £ 94 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | 5 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 13 304 | 10 518 | 105 | 0 | 105 | 0,01 |
| SSB | 01/2024 | £ 5 | \$ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 8 293 | £ 6 572 | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| UAG | 01/2024 | 13 301 | 10 510 | 98 | 0 | 98 | 0,01 |
| | | | | \$ 318 | \$ (2) | \$ 316 | 0,02 |
| Total des Instruments financiers dérivés hors cote | | | | | | \$ 1 098 | 0,06 |
| Total des Investissements | | | | | | \$ 1 851 923 | 98,88 |
| Autres actifs et passifs à court terme | | | | | | \$ 20 964 | 1,12 |
| Actifs nets | | | | | | \$ 1 872 887 | 100,00 |

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

- (a) Titre vendu avant l'émission.
 (b) Titre à rémunération en nature.
 (c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.
 (d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
 (e) Affilié au Fonds.
 (f) Titre convertible conditionnel.
 (g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,39 %) :

| Description de l'émetteur | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---|-------------------------|-----------|--------------|---------------------|
| Altice France S.A, 11,500 % éch. 01/02/2027 | 20/12/2023 | \$ 852 | \$ 890 | 0,05 |
| Intelsat Emergence S.A. | 11/02/2014 - 02/03/2022 | 15 552 | 4 342 | 0,23 |
| Serta Simmons Bedding LLC | 29/06/2023 | 2 634 | 23 | 0,00 |
| | | \$ 19 038 | \$ 5 255 | 0,28 |

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 10 428 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 18 197 \$ (31 décembre 2022 : 10 449 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 630 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 305 | \$ 1 765 023 | \$ 5 584 | \$ 1 770 912 |
| Fonds d'investissement | 74 138 | 0 | 0 | 74 138 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 912 | 0 | 912 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (934) | 6 895 | 0 | 5 961 |
| Totaux | \$ 73 509 | \$ 1 772 830 | \$ 5 584 | \$ 1 851 923 |

Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 413 | \$ 1 889 527 | \$ 5 525 | \$ 1 895 465 |
| Fonds d'investissement | 39 162 | 0 | 0 | 39 162 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 9 269 | 0 | 9 269 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | 11 167 | 0 | 11 167 |
| Totaux | \$ 39 575 | \$ 1 909 963 | \$ 5 525 | \$ 1 955 063 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Contrats de prise en pension | En % de l'actif net |
|---|----------------|-------------------|--------------------|------------------|--|---------------------|
| BOS | (1,000) % | 15/12/2023 | 02/02/2024 | \$ (2 976) | \$ (2 975) | (0,16) |
| | 4,250 | 15/12/2023 | 02/02/2024 | (3 090) | (3 096) | (0,17) |
| BPS | 4,500 | 22/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (791) | (795) | (0,04) |
| | 5,000 | 22/11/2023 | TBD ⁽¹⁾ | (246) | (247) | (0,01) |
| MYI | 2,500 | 17/05/2023 | TBD ⁽¹⁾ | € (968) | (1 087) | (0,06) |
| Total des Contrats de prise en pension | | | | | \$ (8 200) | (0,44) |

⁽¹⁾ Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| BOA | \$ 17 | \$ 0 | \$ 17 | \$ 9 | \$ 0 | \$ 9 |
| BPS | 208 | (310) | (102) | S/O | S/O | S/O |
| BRC | 477 | (1 020) | (543) | 1 | 0 | 1 |
| CBK | (215) | 300 | 85 | 3 592 | (3 540) | 52 |
| GLM | S/O | S/O | S/O | 2 | 0 | 2 |
| JPM | S/O | S/O | S/O | (258) | 0 | (258) |
| MBC | (435) | 330 | (105) | 1 402 | (1 320) | 82 |
| MYI | 253 | (510) | (257) | (4) | 0 | (4) |
| RBC | S/O | S/O | S/O | (1) | 0 | (1) |
| SCX | 105 | 0 | 105 | 3 187 | (3 050) | 137 |
| SSB | 85 | 0 | 85 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | S/O | S/O | S/O | 11 | (20) | (9) |
| UAG | 603 | (1 280) | (677) | 4 | 0 | 4 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 29,96 | 39,23 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 64,32 | 56,03 |
| Autres valeurs mobilières | 0,27 | 0,24 |
| Fonds d'investissement | 3,96 | 1,97 |
| Contrats de mise en pension | 0,05 | 0,47 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,06) | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,32 | 0,16 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,06 | 0,40 |
| Contrats de prise en pension | (0,44) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 2,39 | 0,70 |
| Obligations et billets privés | 89,24 | 79,60 |
| Obligations du Trésor américain | 2,66 | 11,62 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 0,01 | 0,04 |

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|-----------------------------|-----------------------------|
| Titres adossés à des actifs | 0,00 | 0,00 |
| Actions ordinaires | 0,25 | 0,21 |
| Droits | S/O | 0,01 |
| Bons de souscription | 0,00 | 0,00 |
| Titres privilégiés | 0,00 | 0,07 |
| Instruments à court terme | S/O | 3,25 |
| Fonds d'investissement | 3,96 | 1,97 |
| Contrats de mise en pension | 0,05 | 0,47 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,06) | S/O |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines | | |
| - vente de protection | 0,05 | S/O |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,27 | 0,16 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Contrats de change à terme | (0,02) | (0,05) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,08 | 0,45 |
| Autres actifs et passifs à court terme | 1,12 | 1,50 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | Block Financial LLC | | | | Ford Motor Credit Co. LLC | | | |
| CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS | | | | 3,875 % éch. 15/08/2030 \$ 1 500 \$ 1 373 0,29 | | | | 7,350 % éch. 06/03/2030 \$ 200 \$ 215 0,04 | | | |
| Charter Communications Operating LLC | | | | Blue Owl Capital Corp. | | | | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC | | | |
| 7,133 % éch. 01/02/2027 \$ 88 \$ 88 0,02 | | | | 2,875 % éch. 11/06/2028 300 264 0,05 | | | | 7,875 % éch. 01/12/2030 300 313 0,06 | | | |
| 7,360 % éch. 07/12/2030 500 499 0,10 | | | | BNP Paribas S.A. | | | | FS KKR Capital Corp. | | | |
| | | | | 7,750 % éch. 16/08/2029 (d)(f) 700 716 0,15 | | | | 7,875 % éch. 15/01/2029 700 742 0,15 | | | |
| | | | | 8,500 % éch. 14/08/2028 (d)(f) 500 525 0,11 | | | | Gacii First Investment Co. | | | |
| | | | | BPCE S.A. | | | | 5,125 % éch. 14/02/2053 600 545 0,11 | | | |
| | | | | 6,612 % éch. 19/10/2027 500 515 0,11 | | | | GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. | | | |
| | | | | 6,812 % éch. 19/10/2027 500 515 0,11 | | | | 3,400 % éch. 30/09/2026 500 474 0,10 | | | |
| | | | | Brandywine Operating Partnership LP | | | | Global Atlantic Fin Co. | | | |
| | | | | 3,950 % éch. 15/11/2027 500 447 0,09 | | | | 3,125 % éch. 15/06/2031 200 164 0,03 | | | |
| | | | | Brookfield Finance, Inc. | | | | 4,400 % éch. 15/10/2029 800 737 0,15 | | | |
| | | | | 3,500 % éch. 30/03/2051 400 293 0,06 | | | | GLP Capital LP | | | |
| | | | | 3,900 % éch. 25/01/2028 1 400 1 350 0,28 | | | | 3,350 % éch. 01/09/2024 700 691 0,14 | | | |
| | | | | Cantor Fitzgerald LP | | | | 4,000 % éch. 15/01/2031 300 271 0,06 | | | |
| | | | | 7,200 % éch. 12/12/2028 800 821 0,17 | | | | 5,750 % éch. 01/06/2028 700 707 0,15 | | | |
| | | | | Capital One Financial Corp. | | | | Goldman Sachs Group, Inc. | | | |
| | | | | 6,312 % éch. 08/06/2029 400 411 0,09 | | | | 2,383 % éch. 21/07/2032 1 500 1 233 0,26 | | | |
| | | | | Carlyle Finance Subsidiary LLC | | | | 2,615 % éch. 22/04/2032 1 000 840 0,17 | | | |
| | | | | 3,500 % éch. 19/09/2029 1 900 1 779 0,37 | | | | 3,272 % éch. 29/09/2025 1 800 1 770 0,37 | | | |
| | | | | CBRE Services, Inc. | | | | 3,691 % éch. 05/06/2028 655 626 0,13 | | | |
| | | | | 5,950 % éch. 15/08/2034 300 315 0,07 | | | | 5,798 % éch. 10/08/2026 500 505 0,10 | | | |
| | | | | Charles Schwab Corp. | | | | 6,484 % éch. 24/10/2029 1 800 1 911 0,40 | | | |
| | | | | 5,643 % éch. 19/05/2029 800 821 0,17 | | | | Golub Capital BDC, Inc. | | | |
| | | | | 6,196 % éch. 17/11/2029 600 630 0,13 | | | | 7,050 % éch. 05/12/2028 200 210 0,04 | | | |
| | | | | Citigroup, Inc. | | | | Goodman U.S. Finance Three LLC | | | |
| | | | | 2,976 % éch. 05/11/2030 1 600 1 426 0,30 | | | | 3,700 % éch. 15/03/2028 1 600 1 491 0,31 | | | |
| | | | | 3,785 % éch. 17/03/2033 (g) 200 180 0,04 | | | | Great-West Lifeco Finance LP | | | |
| | | | | 4,075 % éch. 23/04/2029 400 385 0,08 | | | | 4,581 % éch. 17/05/2048 300 269 0,06 | | | |
| | | | | 6,270 % éch. 17/11/2033 (g) 2 000 2 141 0,45 | | | | Guardian Life Global Funding | | | |
| | | | | Citizens Bank N.A. | | | | 1,100 % éch. 23/06/2025 2 300 2 172 0,45 | | | |
| | | | | 5,284 % éch. 26/01/2026 500 484 0,10 | | | | Hanover Insurance Group, Inc. | | | |
| | | | | Commonwealth Bank of Australia | | | | 4,500 % éch. 15/04/2026 800 786 0,16 | | | |
| | | | | 3,784 % éch. 14/03/2032 (f) 400 350 0,07 | | | | HAT Holdings LLC | | | |
| | | | | Corebridge Financial, Inc. | | | | 8,000 % éch. 15/06/2027 400 417 0,09 | | | |
| | | | | 3,850 % éch. 05/04/2029 900 849 0,18 | | | | Highwoods Realty LP | | | |
| | | | | Corporate Office Properties LP | | | | 4,125 % éch. 15/03/2028 500 461 0,10 | | | |
| | | | | 2,250 % éch. 15/03/2026 300 280 0,06 | | | | 4,200 % éch. 15/04/2029 200 181 0,04 | | | |
| | | | | 2,750 % éch. 15/04/2031 1 400 1 133 0,24 | | | | Host Hotels & Resorts LP | | | |
| | | | | Credit Acceptance Corp. | | | | 3,500 % éch. 15/09/2030 1 300 1 161 0,24 | | | |
| | | | | 9,250 % éch. 15/12/2028 200 213 0,04 | | | | 4,000 % éch. 15/06/2025 1 233 1 205 0,25 | | | |
| | | | | Crédit Agricole S.A. | | | | HSBC Capital Funding Dollar LP | | | |
| | | | | 6,316 % éch. 03/10/2029 500 524 0,11 | | | | 10,176 % éch. 30/06/2030 (d) 400 509 0,11 | | | |
| | | | | Credit Suisse AG | | | | HSBC Holdings PLC | | | |
| | | | | 7,500 % éch. 15/02/2028 700 767 0,16 | | | | 2,099 % éch. 04/06/2026 900 857 0,18 | | | |
| | | | | Crown Castle, Inc. | | | | 2,357 % éch. 18/08/2031 1 600 1 326 0,28 | | | |
| | | | | 2,100 % éch. 01/04/2031 500 408 0,08 | | | | 4,292 % éch. 12/09/2026 1 000 980 0,20 | | | |
| | | | | 3,100 % éch. 15/11/2029 900 806 0,17 | | | | 4,583 % éch. 19/06/2029 400 388 0,08 | | | |
| | | | | 4,300 % éch. 15/02/2029 600 578 0,12 | | | | 5,402 % éch. 11/08/2033 900 904 0,19 | | | |
| | | | | 4,800 % éch. 01/09/2028 200 198 0,04 | | | | 6,500 % éch. 15/09/2037 100 105 0,02 | | | |
| | | | | CubeSmart LP | | | | 6,800 % éch. 01/06/2038 220 235 0,05 | | | |
| | | | | 3,125 % éch. 01/09/2026 600 570 0,12 | | | | Hudson Pacific Properties LP | | | |
| | | | | Deutsche Bank AG | | | | 4,650 % éch. 01/04/2029 200 162 0,03 | | | |
| | | | | 3,375 % éch. 13/03/2029 € 1 500 1 711 0,36 | | | | 5,950 % éch. 15/02/2028 500 443 0,09 | | | |
| | | | | 6,720 % éch. 18/01/2029 \$ 1 300 1 362 0,28 | | | | Huntington Bancshares, Inc. | | | |
| | | | | EPR Properties | | | | 6,208 % éch. 21/08/2029 400 413 0,09 | | | |
| | | | | 4,500 % éch. 01/06/2027 450 425 0,09 | | | | IHG Finance LLC | | | |
| | | | | 4,750 % éch. 15/12/2026 100 96 0,02 | | | | 4,375 % éch. 28/11/2029 € 500 573 0,12 | | | |
| | | | | 4,950 % éch. 15/04/2028 400 380 0,08 | | | | Invitation Homes Operating Partnership LP | | | |
| | | | | Equitable Financial Life Global Funding | | | | 2,300 % éch. 15/11/2028 \$ 1 300 1 154 0,24 | | | |
| | | | | 5,500 % éch. 02/12/2025 2 100 2 102 0,44 | | | | JAB Holdings BV | | | |
| | | | | Equitable Holdings, Inc. | | | | 2,200 % éch. 23/11/2030 535 431 0,09 | | | |
| | | | | 5,594 % éch. 11/01/2033 200 206 0,04 | | | | Jefferies Financial Group, Inc. | | | |
| | | | | ERP Operating LP | | | | 5,875 % éch. 21/07/2028 600 616 0,13 | | | |
| | | | | 3,250 % éch. 01/08/2027 100 95 0,02 | | | | JPMorgan Chase & Co. | | | |
| | | | | Extra Space Storage LP | | | | 2,182 % éch. 01/06/2028 700 641 0,13 | | | |
| | | | | 2,350 % éch. 15/03/2032 400 326 0,07 | | | | 2,545 % éch. 08/11/2032 900 751 0,16 | | | |
| | | | | 3,875 % éch. 15/12/2027 800 765 0,16 | | | | 2,580 % éch. 22/04/2032 5 100 4 316 0,90 | | | |
| | | | | Fairfax Financial Holdings Ltd. | | | | 3,509 % éch. 23/01/2029 1 505 1 427 0,30 | | | |
| | | | | 2,750 % éch. 29/03/2028 € 200 211 0,04 | | | | 3,782 % éch. 01/02/2028 40 39 0,01 | | | |
| | | | | 4,625 % éch. 29/04/2030 \$ 900 866 0,18 | | | | 4,000 % éch. 01/04/2025 (d) 2 900 2 739 0,57 | | | |
| | | | | 4,850 % éch. 17/04/2028 300 296 0,06 | | | | 5,350 % éch. 01/06/2034 800 812 0,17 | | | |
| | | | | Federal Realty OP LP | | | | 6,087 % éch. 23/10/2029 500 526 0,11 | | | |
| | | | | 3,500 % éch. 01/06/2030 400 363 0,08 | | | | JPMorgan Chase Bank N.A. | | | |
| | | | | Fifth Third Bancorp | | | | 5,110 % éch. 08/12/2026 900 908 0,19 | | | |
| | | | | 4,772 % éch. 28/07/2030 800 782 0,16 | | | | | | | |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| Kilroy Realty LP 3,050 % éch. 15/02/2030 | \$ 1 800 | \$ 1 533 | 0,32 | Santander UK Group Holdings PLC 1,532 % éch. 21/08/2026 | \$ 1 700 | \$ 1 586 | 0,33 | Adani Transmission Step-One Ltd. 4,000 % éch. 03/08/2026 | \$ 400 | \$ 367 | 0,08 |
| KKR Group Finance Co. LLC 3,625 % éch. 25/02/2050 | 1 100 | 791 | 0,16 | SBA Tower Trust 1,884 % éch. 15/07/2050 | 1 000 | 928 | 0,19 | Adventist Health System 5,430 % éch. 01/03/2032 | 300 | 305 | 0,06 |
| Lazard Group LLC 3,625 % éch. 01/03/2027 | 100 | 95 | 0,02 | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % éch. 29/10/2022 ^ | 2 100 | 126 | 0,03 | Air Canada Pass-Through Trust 3,300 % éch. 15/07/2031 | 744 | 669 | 0,14 |
| 4,500 % éch. 19/09/2028 | 200 | 195 | 0,04 | 5,250 % éch. 23/05/2023 ^f) | 600 | 36 | 0,01 | 3,750 % éch. 15/06/2029 | 128 | 118 | 0,02 |
| Legg Mason, Inc. 5,625 % éch. 15/01/2044 | 200 | 205 | 0,04 | SBL Holdings, Inc. 5,125 % éch. 13/11/2026 | 1 000 | 943 | 0,20 | 5,250 % éch. 01/10/2030 | 249 | 245 | 0,05 |
| Lloyds Bank PLC 0,000 % éch. 02/04/2032 | 200 | 129 | 0,03 | SELP Finance SARL 3,750 % éch. 10/08/2027 | € 300 | 332 | 0,07 | Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % éch. 15/02/2029 | 612 | 595 | 0,12 |
| Lloyds Banking Group PLC 5,985 % éch. 07/08/2027 | 1 000 | 1 018 | 0,21 | SLM Corp. 3,125 % éch. 02/11/2026 | \$ 500 | 467 | 0,10 | Alcon Finance Corp. 2,600 % éch. 27/05/2030 | 500 | 434 | 0,09 |
| Metropolitan Life Global Funding 1,875 % éch. 11/01/2027 | 1 400 | 1 280 | 0,27 | SMBC Aviation Capital Finance DAC 3,550 % éch. 15/04/2024 | 1 100 | 1 093 | 0,23 | Allegion U.S. Holding Co., Inc. 3,550 % éch. 01/10/2027 | 1 100 | 1 046 | 0,22 |
| Mid-America Apartments LP 1,100 % éch. 15/09/2026 | 1 200 | 1 089 | 0,23 | Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034 | 200 | 211 | 0,04 | Amdocs Ltd. 2,538 % éch. 15/06/2030 | 1 600 | 1 381 | 0,29 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,309 % éch. 20/07/2032 | 2 000 | 1 661 | 0,35 | 6,750 % éch. 06/04/2028 (d)(f) | 400 | 358 | 0,07 | American Airlines Pass-Through Trust 3,200 % éch. 15/12/2029 | 607 | 554 | 0,12 |
| 5,133 % éch. 20/07/2033 | 900 | 914 | 0,19 | Spirit Realty LP 3,200 % éch. 15/02/2031 | 100 | 88 | 0,02 | 3,250 % éch. 15/04/2030 | 673 | 589 | 0,12 |
| 5,406 % éch. 19/04/2034 | 300 | 311 | 0,06 | 4,000 % éch. 15/07/2029 | 200 | 190 | 0,04 | 3,375 % éch. 01/11/2028 | 345 | 317 | 0,07 |
| 5,441 % éch. 22/02/2034 | 300 | 310 | 0,06 | Standard Chartered PLC 3,265 % éch. 18/02/2036 | 200 | 164 | 0,03 | 3,500 % éch. 15/08/2033 | 405 | 345 | 0,07 |
| Mizuho Financial Group, Inc. 3,153 % éch. 16/07/2030 | 1 873 | 1 687 | 0,35 | 6,296 % éch. 06/07/2034 | 250 | 263 | 0,05 | 3,575 % éch. 15/07/2029 | 133 | 125 | 0,03 |
| Morgan Stanley 4,889 % éch. 20/07/2033 | 1 400 | 1 366 | 0,28 | 6,301 % éch. 09/01/2029 | 1 000 | 1 027 | 0,21 | 3,600 % éch. 15/04/2031 | 211 | 185 | 0,04 |
| 5,250 % éch. 21/04/2034 | 3 600 | 3 601 | 0,75 | Stifel Financial Corp. 4,000 % éch. 15/05/2030 | 600 | 545 | 0,11 | 4,000 % éch. 15/01/2027 | 391 | 374 | 0,08 |
| 6,407 % éch. 01/11/2029 | 1 700 | 1 803 | 0,37 | STORE Capital Corp. 4,500 % éch. 15/03/2028 | 200 | 184 | 0,04 | Amgen, Inc. 5,250 % éch. 02/03/2033 | 500 | 513 | 0,11 |
| Mutual of Omaha Cos. Global Funding 5,450 % éch. 12/12/2028 | 400 | 409 | 0,08 | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % éch. 08/07/2025 | 1 100 | 1 041 | 0,22 | 5,600 % éch. 02/03/2043 | 3 075 | 3 179 | 0,66 |
| Nasdaq, Inc. 5,550 % éch. 15/02/2034 | 400 | 416 | 0,09 | 3,202 % éch. 17/09/2029 (f) | 700 | 637 | 0,13 | Apple, Inc. 4,850 % éch. 10/05/2053 | 2 100 | 2 142 | 0,45 |
| Nationwide Building Society 6,557 % éch. 18/10/2027 | 1 100 | 1 139 | 0,24 | 5,710 % éch. 13/01/2030 | 1 100 | 1 143 | 0,24 | ArcelorMittal S.A. 6,800 % éch. 29/11/2032 | 1 000 | 1 082 | 0,23 |
| NatWest Group PLC 4,892 % éch. 18/05/2029 | 1 700 | 1 671 | 0,35 | 5,716 % éch. 14/09/2028 | 400 | 414 | 0,09 | Ashtead Capital, Inc. 4,000 % éch. 01/05/2028 | 400 | 377 | 0,08 |
| Neuberger Berman Group LLC 4,500 % éch. 15/03/2027 | 1 000 | 959 | 0,20 | Synchrony Financial 7,250 % éch. 02/02/2033 | 1 200 | 1 192 | 0,25 | AstraZeneca PLC 4,000 % éch. 17/01/2029 | 500 | 494 | 0,10 |
| New York Life Global Funding 1,200 % éch. 07/08/2030 | 2 800 | 2 248 | 0,47 | Toyota Motor Credit Corp. 4,625 % éch. 12/01/2028 | 900 | 912 | 0,19 | Bacardi Ltd. 5,250 % éch. 15/01/2029 | 1 100 | 1 100 | 0,23 |
| Nippon Life Insurance Co. 6,250 % éch. 13/09/2053 | 200 | 210 | 0,04 | TP ICAP Finance PLC 5,250 % éch. 29/05/2026 | £ 400 | 494 | 0,10 | BAE Systems PLC 3,400 % éch. 15/04/2030 | 200 | 185 | 0,04 |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % éch. 09/03/2028 | 1 900 | 1 678 | 0,35 | Truist Financial Corp. 7,161 % éch. 30/10/2029 | \$ 900 | 973 | 0,20 | Baptist Healthcare System Obligated Group 3,540 % éch. 15/08/2050 | 300 | 222 | 0,05 |
| Nomura Holdings, Inc. 2,679 % éch. 16/07/2030 | 1 300 | 1 109 | 0,23 | U.S. Bancorp 6,787 % éch. 26/10/2027 | 1 250 | 1 306 | 0,27 | BAT Capital Corp. 7,079 % éch. 02/08/2043 | 500 | 532 | 0,11 |
| 5,386 % éch. 06/07/2027 | 2 100 | 2 109 | 0,44 | UBS Group AG 2,593 % éch. 11/09/2025 | 400 | 391 | 0,08 | Bayer U.S. Finance LLC 4,250 % éch. 15/12/2025 | 1 100 | 1 072 | 0,22 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053 | DKK 9 146 | 1 093 | 0,23 | 3,126 % éch. 13/08/2030 | 900 | 804 | 0,17 | Berry Global, Inc. 1,570 % éch. 15/01/2026 | 1 500 | 1 394 | 0,29 |
| Omega Healthcare Investors, Inc. 4,750 % éch. 15/01/2028 | \$ 1 200 | 1 155 | 0,24 | 4,282 % éch. 09/01/2028 | 1 250 | 1 212 | 0,25 | Boardwalk Pipelines LP 3,400 % éch. 15/02/2031 | 500 | 447 | 0,09 |
| OneMain Finance Corp. 7,875 % éch. 15/03/2030 | 500 | 515 | 0,11 | 5,959 % éch. 12/01/2034 | 1 400 | 1 449 | 0,30 | Boeing Co. 5,930 % éch. 01/05/2060 | 700 | 726 | 0,15 |
| Pacific Life Global Funding 1,375 % éch. 14/04/2026 | 2 600 | 2 404 | 0,50 | 6,537 % éch. 12/08/2033 | 2 750 | 2 936 | 0,61 | Booz Allen Hamilton, Inc. 5,950 % éch. 04/08/2033 | 100 | 106 | 0,02 |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % éch. 23/06/2030 | 300 | 271 | 0,06 | UDR, Inc. 3,100 % éch. 01/11/2034 | 300 | 248 | 0,05 | British Airways Pass-Through Trust 4,125 % éch. 20/03/2033 | 258 | 235 | 0,05 |
| Physicians Realty LP 4,300 % éch. 15/03/2027 | 300 | 292 | 0,06 | 3,500 % éch. 15/01/2028 | 300 | 283 | 0,06 | 4,250 % éch. 15/05/2034 | 200 | 187 | 0,04 |
| Protective Life Global Funding 1,170 % éch. 15/07/2025 | 2 300 | 2 168 | 0,45 | VICI Properties LP 3,875 % éch. 15/02/2029 | 300 | 276 | 0,06 | Broadcom, Inc. 3,469 % éch. 15/04/2034 | 569 | 495 | 0,10 |
| Reliance Standard Life Global Funding 2,500 % éch. 30/10/2024 | 2 200 | 2 142 | 0,45 | 4,500 % éch. 15/01/2028 | 100 | 95 | 0,02 | Burlington Northern Santa Fe LLC 5,200 % éch. 15/04/2054 | 100 | 104 | 0,02 |
| Retail Opportunity Investments Partnership LP 6,750 % éch. 15/10/2028 | 200 | 210 | 0,04 | 5,125 % éch. 15/05/2032 | 600 | 586 | 0,12 | Caesars Entertainment, Inc. 7,000 % éch. 15/02/2030 | 400 | 410 | 0,09 |
| RGA Global Funding 6,000 % éch. 21/11/2028 | 500 | 519 | 0,11 | 5,750 % éch. 01/02/2027 | 100 | 100 | 0,02 | Cameron LNG LLC 3,302 % éch. 15/01/2035 | 1 400 | 1 194 | 0,25 |
| Rocket Mortgage LLC 2,875 % éch. 15/10/2026 | 200 | 185 | 0,04 | Vonovia SE 0,000 % éch. 01/12/2025 (b) | € 1 200 | 1 237 | 0,26 | Canadian Pacific Railway Co. 3,125 % éch. 01/06/2026 | 300 | 288 | 0,06 |
| Sagax AB 2,250 % éch. 13/03/2025 | € 300 | 323 | 0,07 | Wells Fargo & Co. 2,393 % éch. 02/06/2028 | \$ 1 000 | 916 | 0,19 | Carnival Corp. 7,000 % éch. 15/08/2029 | 200 | 209 | 0,04 |
| Santander Holdings USA, Inc. 2,490 % éch. 06/01/2028 | \$ 700 | 641 | 0,13 | 2,406 % éch. 30/10/2025 | 300 | 292 | 0,06 | Carrier Global Corp. 5,800 % éch. 30/11/2025 | 400 | 406 | 0,08 |
| 4,400 % éch. 13/07/2027 | 400 | 389 | 0,08 | 3,196 % éch. 17/06/2027 | 4 400 | 4 208 | 0,88 | CDW LLC 3,569 % éch. 01/12/2031 | 700 | 622 | 0,13 |
| 6,499 % éch. 09/03/2029 | 600 | 620 | 0,13 | 4,897 % éch. 25/07/2033 | 2 100 | 2 047 | 0,43 | Centene Corp. 2,450 % éch. 15/07/2028 | 1 100 | 981 | 0,20 |
| | | | | 5,557 % éch. 25/07/2034 | 100 | 102 | 0,02 | Charter Communications Operating LLC 4,200 % éch. 15/03/2028 | 1 300 | 1 250 | 0,26 |
| | | | | 6,491 % éch. 23/10/2034 | 700 | 762 | 0,16 | | | | |
| | | | | Weyerhaeuser Co. 4,000 % éch. 15/04/2030 | 1 300 | 1 239 | 0,26 | | | | |
| | | | | 4,750 % éch. 15/05/2026 | 600 | 597 | 0,12 | | | | |
| | | | | 7,375 % éch. 15/03/2032 | 343 | 398 | 0,08 | | | | |
| | | | | | | 194 246 | 40,40 | | | | |
| | | | | INDUSTRIE | | | | | | | |
| | | | | AbbVie, Inc. 4,250 % éch. 21/11/2049 | 200 | 178 | 0,04 | | | | |
| | | | | 4,850 % éch. 15/06/2044 | 400 | 390 | 0,08 | | | | |

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) \$ 1 600 | JUSTE VALEUR (en milliers) \$ 1 636 | EN % DE L'ACTIF NET 0,34 | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|--|---|--|--------------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| 6,150 % éch. 10/11/2026 | | | | Greensaif Pipelines Bidco SARL | \$ 300 | \$ 313 | 0,07 | Mundys SpA | € 100 | \$ 102 | 0,02 |
| Cheniere Energy Partners LP | | | | Haleon U.S. Capital LLC | 2 400 | 2 271 | 0,47 | Netflix, Inc. | \$ 400 | 405 | 0,08 |
| 3,250 % éch. 31/01/2032 | 400 | 341 | 0,07 | 3,375 % éch. 24/03/2029 | | | | Newmont Corp. | | 200 | 0,04 |
| 4,000 % éch. 01/03/2031 | 2 100 | 1 912 | 0,40 | 3,625 % éch. 24/03/2032 | 750 | 692 | 0,14 | 5,750 % éch. 15/11/2041 | | 207 | |
| 5,950 % éch. 30/06/2033 | 600 | 617 | 0,13 | HCA, Inc. | | | | NextEra Energy Operating Partners LP | 200 | 544 | 0,11 |
| Cheniere Energy, Inc. | | | | 3,500 % éch. 01/09/2030 | 1 000 | 907 | 0,19 | 4,250 % éch. 15/07/2024 | 550 | | |
| 4,625 % éch. 15/10/2028 | 800 | 781 | 0,16 | 3,500 % éch. 15/07/2051 | 700 | 494 | 0,10 | Norfolk Southern Corp. | | 45 | 0,01 |
| Cigna Group | | | | 5,500 % éch. 01/06/2033 | 900 | 915 | 0,19 | 4,100 % éch. 15/05/2049 | 45 | 38 | 0,01 |
| 4,375 % éch. 15/10/2028 | 1 400 | 1 389 | 0,29 | 5,625 % éch. 01/09/2028 | 200 | 205 | 0,04 | 5,950 % éch. 15/03/2064 | 200 | 223 | 0,05 |
| Cloud Software Group, Inc. | | | | Health & Happiness International Holdings Ltd. | | | | Northern Star Resources Ltd. | | | |
| 6,500 % éch. 31/03/2029 | 100 | 95 | 0,02 | 13,500 % éch. 26/06/2026 | 600 | 580 | 0,12 | 6,125 % éch. 11/04/2033 | 1 100 | 1 106 | 0,23 |
| Comcast Corp. | | | | Howard Midstream Energy Partners LLC | | | | NVR, Inc. | | | |
| 5,500 % éch. 15/05/2064 | 500 | 527 | 0,11 | 8,875 % éch. 15/07/2028 | 200 | 210 | 0,04 | 3,000 % éch. 15/05/2030 | 300 | 267 | 0,06 |
| ConocoPhillips Co. | | | | Humana, Inc. | | | | NXP BV | | | |
| 5,550 % éch. 15/03/2054 | 300 | 319 | 0,07 | 5,750 % éch. 01/03/2028 | 500 | 520 | 0,11 | 4,875 % éch. 01/03/2024 | 1 100 | 1 098 | 0,23 |
| Continental Airlines Pass-Through Trust | | | | 5,875 % éch. 01/03/2033 | 800 | 853 | 0,18 | Occidental Petroleum Corp. | | | |
| 4,000 % éch. 29/04/2026 | 201 | 197 | 0,04 | Hyundai Capital America | | | | 8,875 % éch. 15/07/2030 | 1 300 | 1 523 | 0,32 |
| Continental Resources, Inc. | | | | 2,000 % éch. 15/06/2028 | 1 600 | 1 399 | 0,29 | OCI NV | | | |
| 5,750 % éch. 15/01/2031 | 400 | 398 | 0,08 | 6,532 % éch. 04/08/2025 | 300 | 300 | 0,06 | 6,700 % éch. 16/03/2033 | 400 | 409 | 0,09 |
| CVS Health Corp. | | | | Illumina, Inc. | | | | Oracle Corp. | | | |
| 4,125 % éch. 01/04/2040 | 900 | 774 | 0,16 | 5,750 % éch. 13/12/2027 | 900 | 924 | 0,19 | 4,000 % éch. 15/07/2046 | 600 | 482 | 0,10 |
| 5,125 % éch. 21/02/2030 | 1 500 | 1 524 | 0,32 | Imperial Brands Finance PLC | | | | 4,000 % éch. 15/11/2047 | 600 | 476 | 0,10 |
| CVS Pass-Through Trust | | | | 3,875 % éch. 26/07/2029 | 600 | 560 | 0,12 | 4,650 % éch. 06/05/2030 | 1 100 | 1 096 | 0,23 |
| 5,789 % éch. 10/01/2026 | 29 | 29 | 0,01 | 4,250 % éch. 21/07/2025 | 500 | 491 | 0,10 | 6,250 % éch. 09/11/2032 (g) | 1 000 | 1 088 | 0,23 |
| 6,036 % éch. 10/12/2028 | 122 | 123 | 0,03 | Infor, Inc. | | | | Pacific National Finance Pty. Ltd. | | | |
| DAE Funding LLC | | | | 1,750 % éch. 15/07/2025 | 600 | 566 | 0,12 | 4,750 % éch. 22/03/2028 | 1 700 | 1 594 | 0,33 |
| 1,625 % éch. 15/02/2024 | 700 | 696 | 0,14 | Intel Corp. | | | | Penske Truck Leasing Co. LP | | | |
| Dell International LLC | | | | 5,200 % éch. 10/02/2033 | 1 200 | 1 254 | 0,26 | 4,450 % éch. 29/01/2026 | 100 | 98 | 0,02 |
| 6,020 % éch. 15/06/2026 | 548 | 561 | 0,12 | Jabil, Inc. | | | | Petroleos Mexicanos | | | |
| 6,200 % éch. 15/07/2030 | 900 | 966 | 0,20 | 5,450 % éch. 01/02/2029 | 200 | 205 | 0,04 | 7,690 % éch. 23/01/2050 | 100 | 71 | 0,01 |
| Delta Air Lines Pass-Through Trust | | | | JDE Peet's NV | | | | 10,000 % éch. 07/02/2033 | 400 | 402 | 0,08 |
| 2,000 % éch. 10/12/2029 | 870 | 772 | 0,16 | 2,250 % éch. 24/09/2031 | 400 | 321 | 0,07 | Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. | | | |
| Directv Financing LLC | | | | 4,125 % éch. 23/01/2030 | € 400 | 455 | 0,09 | 5,340 % éch. 19/05/2063 | 1 200 | 1 213 | 0,25 |
| 5,875 % éch. 15/08/2027 | 1 100 | 1 034 | 0,22 | JetBlue Pass-Through Trust | | | | Philip Morris International, Inc. | | | |
| Dyno Nobel Finance LLC | | | | 2,750 % éch. 15/11/2033 | \$ 245 | 207 | 0,04 | 5,125 % éch. 15/02/2030 | 2 000 | 2 034 | 0,42 |
| 3,950 % éch. 03/08/2027 | 500 | 480 | 0,10 | 4,000 % éch. 15/05/2034 | 80 | 74 | 0,02 | 5,750 % éch. 17/11/2032 | 200 | 210 | 0,04 |
| Eastern Gas Transmission & Storage, Inc. | | | | Kenvue, Inc. | | | | Phosagro QAO Via Phosagro Bond Funding DAC | | | |
| 3,900 % éch. 15/11/2049 | 2 300 | 1 705 | 0,35 | 5,100 % éch. 22/03/2043 | 300 | 312 | 0,07 | 3,050 % éch. 23/01/2025 | 400 | 340 | 0,07 |
| Ecopetrol S.A. | | | | Kinder Morgan, Inc. | | | | POSCO | | | |
| 8,875 % éch. 13/01/2033 | 300 | 326 | 0,07 | 4,800 % éch. 01/02/2033 | 300 | 289 | 0,06 | 5,625 % éch. 17/01/2026 | 900 | 908 | 0,19 |
| Elevance Health, Inc. | | | | 5,200 % éch. 01/06/2033 | 600 | 597 | 0,12 | Royalty Pharma PLC | | | |
| 4,750 % éch. 15/02/2033 | 1 800 | 1 802 | 0,37 | Kraft Heinz Foods Co. | | | | 3,550 % éch. 02/09/2050 | 711 | 506 | 0,11 |
| Energy Transfer LP | | | | 6,875 % éch. 26/01/2039 | 550 | 635 | 0,13 | RTX Corp. | | | |
| 4,400 % éch. 15/03/2027 | 1 400 | 1 370 | 0,29 | Las Vegas Sands Corp. | | | | 6,400 % éch. 15/03/2054 | 500 | 579 | 0,12 |
| 5,750 % éch. 15/02/2033 | 1 000 | 1 032 | 0,21 | 2,900 % éch. 25/06/2025 | 1 500 | 1 442 | 0,30 | Sabine Pass Liquefaction LLC | | | |
| 5,950 % éch. 01/10/2043 | 100 | 99 | 0,02 | 3,900 % éch. 08/08/2029 | 600 | 554 | 0,12 | 5,000 % éch. 15/03/2027 | 300 | 301 | 0,06 |
| 6,050 % éch. 01/12/2026 | 300 | 309 | 0,06 | Leidos, Inc. | | | | Sands China Ltd. | | | |
| 6,500 % éch. 01/02/2042 | 100 | 106 | 0,02 | 4,375 % éch. 15/05/2030 | 600 | 575 | 0,12 | 3,100 % éch. 08/03/2029 | 1 000 | 873 | 0,18 |
| EnLink Midstream LLC | | | | LG Energy Solution Ltd. | | | | 3,500 % éch. 08/08/2031 | 400 | 336 | 0,07 |
| 6,500 % éch. 01/09/2030 | 700 | 715 | 0,15 | 5,750 % éch. 25/09/2028 | 700 | 722 | 0,15 | 4,300 % éch. 08/01/2026 | 600 | 577 | 0,12 |
| Enterprise Products Operating LLC | | | | Marriott International, Inc. | | | | Santos Finance Ltd. | | | |
| 2,800 % éch. 31/01/2030 | 1 000 | 905 | 0,19 | 3,500 % éch. 15/10/2032 | 200 | 178 | 0,04 | 5,250 % éch. 13/03/2029 | 1 600 | 1 567 | 0,33 |
| 5,700 % éch. 15/02/2042 | 300 | 317 | 0,07 | Mattel, Inc. | | | | Spirit AeroSystems, Inc. | | | |
| Equifax, Inc. | | | | 3,375 % éch. 01/04/2026 | 500 | 476 | 0,10 | 9,375 % éch. 30/11/2029 | 200 | 219 | 0,05 |
| 5,100 % éch. 01/06/2028 | 500 | 505 | 0,11 | McCormick & Co., Inc. | | | | 9,750 % éch. 15/11/2030 | 400 | 431 | 0,09 |
| ERAC USA Finance LLC | | | | 4,950 % éch. 15/04/2033 | 900 | 904 | 0,19 | Spirit Airlines Pass-Through Trust | | | |
| 3,300 % éch. 01/12/2026 | 1 000 | 958 | 0,20 | Melco Resorts Finance Ltd. | | | | 3,650 % éch. 15/08/2031 | 418 | 343 | 0,07 |
| Expedia Group, Inc. | | | | 4,875 % éch. 06/06/2025 | 1 000 | 971 | 0,20 | 4,100 % éch. 01/10/2029 | 113 | 104 | 0,02 |
| 5,000 % éch. 15/02/2026 | 1 300 | 1 299 | 0,27 | 5,250 % éch. 26/04/2026 | 600 | 579 | 0,12 | Stryker Corp. | | | |
| Ferguson Finance PLC | | | | Meta Platforms, Inc. | | | | 4,850 % éch. 08/12/2028 | 600 | 607 | 0,13 |
| 3,250 % éch. 02/06/2030 | 300 | 269 | 0,06 | 5,600 % éch. 15/05/2053 | 800 | 868 | 0,18 | Sutter Health | | | |
| Flex Ltd. | | | | MGM China Holdings Ltd. | | | | 5,164 % éch. 15/08/2033 | 100 | 101 | 0,02 |
| 4,750 % éch. 15/06/2025 | 300 | 297 | 0,06 | 5,250 % éch. 18/06/2025 | 900 | 885 | 0,18 | Sysco Corp. | | | |
| Fox Corp. | | | | 5,375 % éch. 15/05/2024 | 200 | 199 | 0,04 | 3,150 % éch. 14/12/2051 | 300 | 215 | 0,04 |
| 6,500 % éch. 13/10/2033 | 100 | 108 | 0,02 | Micron Technology, Inc. | | | | T-Mobile USA, Inc. | | | |
| Gatwick Funding Ltd. | | | | 4,663 % éch. 15/02/2030 | 950 | 928 | 0,19 | 2,550 % éch. 15/02/2031 | 4 300 | 3 706 | 0,77 |
| 6,125 % éch. 02/03/2028 | £ 200 | 261 | 0,05 | Mitchells & Butlers Finance PLC | | | | 2,875 % éch. 15/02/2031 | 365 | 322 | 0,07 |
| Glencore Funding LLC | | | | 6,013 % éch. 15/12/2030 | £ 404 | 489 | 0,10 | Tapestry, Inc. | | | |
| 5,400 % éch. 08/05/2028 | \$ 400 | 408 | 0,09 | Moody's Corp. | | | | 7,350 % éch. 27/11/2028 | 300 | 315 | 0,07 |
| Global Payments, Inc. | | | | 3,250 % éch. 20/05/2050 | \$ 900 | 664 | 0,14 | 7,700 % éch. 27/11/2030 | 300 | 316 | 0,07 |
| 2,900 % éch. 15/05/2030 | 600 | 528 | 0,11 | Motorola Solutions, Inc. | | | | Targa Resources Corp. | | | |
| GN Bondco LLC | | | | 2,300 % éch. 15/11/2030 | 300 | 253 | 0,05 | 5,200 % éch. 01/07/2027 | 700 | 704 | 0,15 |
| 9,500 % éch. 15/10/2031 | 400 | 391 | 0,08 | MSCI, Inc. | | | | 6,125 % éch. 15/03/2033 | 200 | 211 | 0,04 |
| Greene King Finance PLC | | | | 3,250 % éch. 15/08/2033 | 200 | 167 | 0,03 | | | | |
| 5,318 % éch. 15/09/2031 | £ 106 | 133 | 0,03 | 3,875 % éch. 15/02/2031 | 100 | 92 | 0,02 | | | | |

| Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20/12/2026 | \$ 900 | \$ (5) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 1 000 | 21 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2025 | 200 | 6 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 500 | 11 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20/06/2027 | 2 900 | 210 | 0,04 |
| BP Capital Markets PLC | 1,000 | 20/12/2025 | € 700 | (3) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/12/2024 | 400 | (3) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/06/2028 | 1 100 | 24 | 0,01 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20/12/2028 | 500 | 8 | 0,00 |
| Cellnex Telecom S.A. | 5,000 | 20/12/2030 | 400 | 9 | 0,00 |
| Devon Energy Corp. | 1,000 | 20/12/2026 | \$ 800 | 15 | 0,00 |
| Enbridge, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 900 | 3 | 0,00 |
| Exelon Generation Co. LLC | 1,000 | 20/12/2024 | 1 600 | (4) | 0,00 |
| Expedia Group, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 300 | 2 | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20/12/2024 | 1 300 | (94) | (0,02) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2024 | 300 | 6 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/06/2026 | 1 200 | 9 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20/12/2026 | 200 | 1 | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20/12/2026 | 710 | (59) | (0,01) |
| General Motors Co. | 5,000 | 20/06/2028 | 890 | 25 | 0,01 |
| Hess Corp. | 1,000 | 20/12/2026 | 1 200 | 27 | 0,01 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20/12/2024 | 1 400 | (26) | (0,01) |
| National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. | 1,000 | 20/12/2026 | 200 | 0 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20/12/2024 | € 1 600 | 234 | 0,05 |
| Southwest Airlines Co. | 1,000 | 20/12/2026 | \$ 550 | 8 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20/06/2028 | € 800 | 13 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/12/2024 | 1 000 | (13) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/12/2027 | 1 050 | 24 | 0,01 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20/06/2028 | 100 | 2 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2026 | \$ 1 200 | (15) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2026 | 1 800 | (21) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/06/2028 | 1 100 | 14 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20/12/2028 | 300 | 4 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20/06/2024 | € 200 | (5) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20/06/2028 | 1 600 | (6) | 0,00 |
| | | | | \$ 427 | 0,09 |

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--------------------------------|----------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | 1,000 % | 20/12/2028 | \$ 60 700 | \$ 540 | 0,11 |

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Taux variable à payer/ à recevoir | Indice de taux variable | Taux fixe | Date d'échéance | Montant notionnel | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------|-----------------|-------------------|-----------------------------------|---------------------|
| À payer | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 1,175 % | 28/02/2052 | £ 200 | \$ (105) | (0,02) |
| À recevoir ⁽³⁾ | SONIO GBP composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 20/03/2034 | 500 | (51) | (0,01) |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 0,300 | 20/03/2028 | ¥ 231 200 | 59 | 0,01 |
| À recevoir | MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour | 1,000 | 20/09/2043 | 170 000 | 37 | 0,01 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,684 | 03/01/2034 | \$ 200 | (3) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,750 | 02/01/2034 | 200 | (4) | 0,00 |
| À recevoir ⁽³⁾ | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,810 | 02/01/2034 | 200 | (5) | 0,00 |
| À recevoir | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 3,854 | 29/12/2033 | 400 | (11) | (0,01) |
| À payer | SOFR USD composé-OIS à 1 jour | 4,500 | 18/07/2024 | 11 200 | 12 | 0,00 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/09/2025 | CAD 100 | 1 | 0,00 |
| À payer | CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois | 3,750 | 20/12/2025 | 16 300 | 186 | 0,04 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,195 | 25/04/2027 | ZAR 22 300 | 23 | 0,00 |
| À recevoir | JIBAR ZAR à 3 mois | 7,300 | 28/04/2027 | 3 900 | 3 | 0,00 |
| À payer | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/09/2033 | AUD 4 300 | 103 | 0,02 |
| À payer ⁽³⁾ | BBR-BBSW AUD à 6 mois | 4,500 | 20/03/2034 | 4 500 | 104 | 0,02 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 0,000 | 17/03/2053 | € 3 850 | 1 740 | 0,37 |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,750 | 20/03/2054 | 600 | (56) | (0,01) |
| À recevoir ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,760 | 03/01/2029 | 300 | (4) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,880 | 19/12/2028 | 500 | (10) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,920 | 13/12/2028 | 500 | (11) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 2,950 | 29/12/2028 | 300 | (7) | 0,00 |
| À payer ⁽³⁾ | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,000 | 20/03/2034 | 800 | 33 | 0,01 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,179 | 29/11/2028 | 200 | (7) | 0,00 |
| À recevoir | EURIBOR EUR à 6 mois | 3,255 | 22/11/2028 | 200 | (8) | 0,00 |
| | | | | | \$ 2 019 | 0,43 |
| | | | | | \$ 2 986 | 0,63 |

Total des Instruments financiers dérivés compensés

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

OPTIONS ACHETÉES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|------|--------------|---------------------|
| GLM | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 4,975 % | 29/05/2024 | 5 200 | \$ 6 | \$ 2 | 0,00 |

OPTIONS VENDUES

SWAPIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

| Contrepartie | Description | Indice de taux variable | Taux variable à payer/ à recevoir | Taux d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|-------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,288 % | 19/01/2024 | 100 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,738 | 19/01/2024 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,494 | 08/01/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,545 | 16/01/2024 | 400 | (2) | (5) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,994 | 08/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,995 | 16/01/2024 | 400 | (2) | 0 | 0,00 |
| CBK | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,235 | 22/01/2024 | 400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,685 | 22/01/2024 | 400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,310 | 18/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,590 | 05/01/2024 | 300 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,700 | 18/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,960 | 05/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| GLM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,195 | 29/05/2024 | 2 600 | (6) | (10) | (0,01) |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,215 | 22/01/2024 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,285 | 19/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,300 | 16/01/2024 | 400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,560 | 05/01/2024 | 400 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,594 | 05/01/2024 | 400 | (2) | (5) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,648 | 04/01/2024 | 400 | (2) | (7) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,665 | 22/01/2024 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,735 | 19/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 16/01/2024 | 400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,010 | 05/01/2024 | 400 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,044 | 05/01/2024 | 400 | (2) | 0 | 0,00 |
| GST | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,440 | 08/01/2024 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,860 | 08/01/2024 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,170 | 29/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,205 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,350 | 18/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,620 | 29/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,655 | 22/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,750 | 18/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,490 | 12/01/2024 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,650 | 04/01/2024 | 400 | (1) | (6) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,890 | 12/01/2024 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 3,030 | 04/01/2024 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| MYC | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,455 | 08/01/2024 | 400 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,475 | 08/01/2024 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,600 | 12/01/2024 | 200 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À recevoir | 3,670 | 04/01/2024 | 400 | (2) | (7) | (0,01) |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,955 | 08/01/2024 | 400 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 3,975 | 08/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,050 | 12/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | LIBOR USD à 3 mois | À payer | 4,120 | 04/01/2024 | 400 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À recevoir | 2,330 | 15/01/2024 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote | EURIBOR EUR à 6 mois | À payer | 2,740 | 15/01/2024 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | \$ (66) | \$ (78) | (0,02) |

OPTIONS SUR TITRES

| Contrepartie | Description | Prix d'exercice | Date d'expiration | Montant notionnel ⁽¹⁾ | Prime | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|--|-----------------|-------------------|----------------------------------|---------|--------------|---------------------|
| BOA | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | \$ 97,891 | 09/01/2024 | 500 | \$ (2) | \$ (6) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 101,094 | 06/02/2024 | 400 | (1) | (3) | 0,00 |
| JPM | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 99,227 | 06/02/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | 101,227 | 06/02/2024 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| SAL | Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 95,813 | 06/02/2024 | 500 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | 97,813 | 06/02/2024 | 500 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | 99,906 | 09/01/2024 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | \$ (11) | \$ (16) | 0,00 |

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION⁽¹⁾

| Contrepartie | Entité de référence | Taux fixe à recevoir | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Primes payées/(reçues) | Plus-value/(moins-value) latente | Juste valeur | En % de l'actif net |
|--------------|---|----------------------|-----------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------|---------------------|
| BOA | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 % | 20/06/2026 | \$ 100 | \$ (4) | \$ 5 | \$ 1 | 0,00 |
| BRC | Alibaba Group Holding Ltd. | 1,000 | 20/12/2024 | 400 | 5 | (2) | 3 | 0,00 |
| | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20/12/2025 | 500 | 11 | (5) | 6 | 0,01 |
| | Pertamina Persero PT | 1,000 | 20/12/2024 | 400 | (2) | 5 | 3 | 0,00 |
| DUB | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2025 | 300 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| GST | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 200 | (2) | 4 | 2 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2025 | 300 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| JPM | Banco do Brasil S.A. | 1,000 | 20/12/2024 | 400 | (9) | 9 | 0 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement saoudien | 1,000 | 20/06/2025 | 400 | 0 | 4 | 4 | 0,00 |
| MYC | Obligation internationale du gouvernement brésilien | 1,000 | 20/06/2027 | 1 000 | (62) | 68 | 6 | 0,00 |
| | Brookfield Asset Management, Inc. | 1,000 | 20/06/2025 | 300 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2024 | 100 | (1) | 2 | 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2026 | 200 | 1 | 2 | 3 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/06/2028 | 100 | (3) | 4 | 1 | 0,00 |
| | Obligation internationale du gouvernement mexicain | 1,000 | 20/12/2028 | 300 | (3) | 5 | 2 | 0,00 |
| | | | | | \$ (69) | \$ 110 | \$ 41 | 0,01 |

⁽¹⁾ Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

⁽²⁾ Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/(moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|--|---------------------|
| AZD | 01/2024 | \$ 1 558 | AUD 2 351 | \$ 46 | \$ 0 | \$ 46 | 0,01 |
| BOA | 01/2024 | £ 102 | \$ 129 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 050 | ¥ 155 011 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| | 01/2024 | 585 | NOK 6 221 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| BPS | 01/2024 | DKK 2 918 | \$ 430 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | € 461 | 502 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | £ 387 | 491 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 624 | ¥ 91 900 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| | 01/2024 | 181 | ZAR 3 320 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 13 253 | \$ 715 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 77 | IDR 1 181 351 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | € 241 | \$ 263 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 57 | TRY 1 724 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 287 | 9 012 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 04/2024 | 307 | 9 900 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | MXN 17 748 | \$ 982 | 0 | (61) | (61) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 141 | NOK 1 505 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 8 052 | \$ 423 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 02/2024 | \$ 864 | BRL 4 348 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| | 03/2024 | 92 | IDR 1 412 365 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | AUD 721 | \$ 476 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 01/2024 | CAD 4 241 | 3 134 | 0 | (83) | (83) | (0,03) |
| | 01/2024 | DKK 3 865 | 570 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 01/2024 | ¥ 11 000 | 77 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 18 509 | 1 062 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| | 01/2024 | \$ 469 | MXN 8 233 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 10 036 | \$ 528 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 02/2024 | BRL 4 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 152 | IDR 2 340 854 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2024 | 63 | TRY 1 968 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | 02/2024 | 1 307 | INR 109 187 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 03/2024 | 75 | IDR 1 159 253 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | CAD 721 | \$ 547 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | € 10 557 | 11 603 | 0 | (61) | (61) | (0,01) |
| | 01/2024 | £ 105 | 134 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | MXN 4 853 | 280 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 13 | € 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | 405 | £ 317 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | 399 | ¥ 58 883 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 01/2024 | ZAR 38 593 | \$ 2 012 | 0 | (96) | (96) | (0,02) |
| | 03/2024 | \$ 805 | IDR 12 387 801 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | £ 1 740 | \$ 2 201 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| | 03/2024 | \$ 67 | IDR 1 033 834 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 225 | \$ (442) | \$ (217) | (0,05) |

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | € 21 | \$ 23 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | € 98 | \$ 107 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 29 563 | € 26 894 | 153 | 0 | 153 | 0,03 |
| BRC | 01/2024 | € 102 | \$ 112 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 28 056 | € 25 511 | 131 | 0 | 131 | 0,03 |
| CBK | 01/2024 | € 48 | \$ 52 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | \$ 28 045 | € 25 516 | 147 | 0 | 147 | 0,03 |
| SCX | 01/2024 | € 4 | \$ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | \$ 431 | \$ (4) | \$ 427 | 0,09 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution II :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BOA | 01/2024 | \$ 2 375 | £ 1 875 | \$ 15 | \$ 0 | \$ 15 | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ 294 | \$ 374 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 9 123 | £ 7 219 | 80 | 0 | 80 | 0,02 |
| BRC | 01/2024 | £ 57 | \$ 73 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 130 | £ 103 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | £ 818 | \$ 1 034 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 94 | £ 74 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| DUB | 01/2024 | £ 14 | \$ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | £ 21 | \$ 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | £ 391 | \$ 495 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 56 | £ 45 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | £ 89 | \$ 112 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 11 727 | £ 9 272 | 92 | 0 | 92 | 0,02 |
| SSB | 01/2024 | £ 11 805 | \$ 9 355 | 122 | 0 | 122 | 0,02 |
| | | | | \$ 311 | \$ (15) | \$ 296 | 0,06 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 455 0,09

Total des Investissements

\$ 512 000 106,48

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (31 139) (6,48)

Actifs nets

\$ 480 861 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,92 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|--------------|----------|--------------|---------------------|
| Citigroup, Inc. | 3,785 % | 17/03/2033 | 10/03/2022 | \$ 200 | \$ 180 | 0,04 |
| Citigroup, Inc. | 6,270 | 17/11/2033 | 09/11/2022 | 2 000 | 2 141 | 0,45 |
| Oracle Corp. | 6,250 | 09/11/2032 | 07/11/2022 | 998 | 1 088 | 0,23 |
| | | | | \$ 3 198 | \$ 3 409 | 0,72 |

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 12 732 \$) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 8 248 \$ (31 décembre 2022 : 11 785 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 110 \$ (31 décembre 2022 : 830 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 725 | \$ 486 459 | \$ 162 | \$ 487 346 |
| Fonds d'investissement | 18 239 | 0 | 0 | 18 239 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 259 | 0 | 259 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | (25) | 6 181 | 0 | 6 156 |
| Totaux | \$ 18 939 | \$ 492 899 | \$ 162 | \$ 512 000 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|-------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 672 | \$ 345 328 | \$ 399 | \$ 346 399 |
| Fonds d'investissement | 38 657 | 0 | 0 | 38 657 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 15 383 | 0 | 15 383 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 587 | 303 | 0 | 890 |
| Titres vendus à découvert | 0 | (2 035) | 0 | (2 035) |
| Totaux | \$ 39 916 | \$ 358 979 | \$ 399 | \$ 399 294 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ 46 | \$ 0 | \$ 46 | \$ S/O | \$ S/O | \$ S/O |
| BOA | 85 | 0 | 85 | (108) | 0 | (108) |
| BPS | 232 | (420) | (188) | (856) | 740 | (116) |
| BRC | 129 | (280) | (151) | 14 | 0 | 14 |
| CBK | (57) | 0 | (57) | 988 | (750) | 238 |
| CLY | S/O | S/O | S/O | (36) | 0 | (36) |
| DUB | 3 | 0 | 3 | (1) | 0 | (1) |
| FBF | S/O | S/O | S/O | 8 | 0 | 8 |
| GLM | (165) | 0 | (165) | 138 | 0 | 138 |
| GST | 4 | 0 | 4 | 23 | 0 | 23 |
| JPM | (12) | 0 | (12) | 240 | (170) | 70 |
| MYC | 1 | 90 | 91 | (71) | 90 | 19 |
| MYI | (2) | 20 | 18 | (5) | (10) | (15) |
| RYL | S/O | S/O | S/O | 294 | 0 | 294 |
| SAL | (5) | 0 | (5) | (3) | 0 | (3) |
| SCX | 74 | 0 | 74 | 979 | (930) | 49 |
| SSB | 122 | 0 | 122 | 45 | 0 | 45 |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 66,97 | 59,33 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 34,39 | 29,34 |
| Autres valeurs mobilières | S/O | 0,48 |
| Fonds d'investissement | 3,79 | 9,95 |
| Contrats de mise en pension | 0,05 | 3,96 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | 0,56 | 0,18 |
| Instruments financiers dérivés compensés | 0,63 | (0,37) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | 0,09 | 0,42 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (0,52) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | S/O | (9,95) |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|---|----------------------|----------------------|
| Crédits consortiaux et cessions | 0,12 | 1,26 |
| Obligations et billets privés | 79,76 | 67,65 |
| Agences du gouvernement américain | 9,12 | 5,09 |
| Obligations du Trésor américain | 8,15 | 8,62 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux | 0,60 | 0,26 |
| Titres adossés à des actifs | 1,56 | 0,52 |
| Émissions souveraines | 1,43 | 2,12 |
| Actions ordinaires | 0,00 | 0,00 |
| Bons de souscription | 0,00 | 0,00 |
| Titres privilégiés | 0,15 | 0,17 |
| Instruments à court terme | 0,47 | 3,46 |
| Fonds d'investissement | 3,79 | 9,95 |
| Contrats de mise en pension | 0,05 | 3,96 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | 0,56 | 0,18 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines | | |
| - vente de protection | 0,09 | (0,05) |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | 0,11 | (0,03) |
| Swaps de taux d'intérêt | 0,43 | (0,29) |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Options achetées | | |
| Swaptions de taux d'intérêt | 0,00 | 0,54 |
| Options vendues | | |
| Swaptions de défaillance sur indices de crédit | S/O | 0,00 |
| Swaptions de taux d'intérêt | (0,02) | (0,96) |
| Options sur titres | 0,00 | (0,01) |
| Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines | | |
| - vente de protection | 0,01 | 0,01 |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection | S/O | 0,01 |
| Contrats de change à terme | (0,05) | (0,06) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,15 | 0,89 |
| Titres vendus à découvert | S/O | (0,52) |
| Autres actifs et passifs à court terme | (6,48) | (2,77) |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| VALEURS MOBILIÈRES | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | Voya Euro CLO DAC | | | |
| AUSTRALIE | | | | Avolon Holdings Funding Ltd. | | | | 4,715 % éch. 15/10/2030 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,875 % éch. 15/02/2025 | | | | € 9 346 \$ 10 228 0,55 | | | |
| Ausgrid Finance Pty. Ltd. | | | | \$ 2 500 | \$ 2 413 | 0,13 | | | | | |
| 3,750 % éch. 30/10/2024 | AUD 4 690 | \$ 3 167 | 0,17 | 3,950 % éch. 01/07/2024 | 1 000 | 987 | 0,05 | | | | |
| 5,562 % éch. 30/10/2024 | 6 100 | 4 171 | 0,22 | 5,250 % éch. 15/05/2024 | 2 000 | 1 990 | 0,11 | | | | |
| ING Bank Australia Ltd. | | | | Park Aerospace Holdings Ltd. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 5,158 % éch. 26/05/2025 | 10 200 | 6 973 | 0,38 | 5,500 % éch. 15/02/2024 | 2 875 | 2 870 | 0,16 | AerCap Ireland Capital DAC | | | |
| Toyota Finance Australia Ltd. | | | | QNB Finance Ltd. | | | | 1,650 % éch. 29/10/2024 | | | |
| 4,790 % éch. 09/09/2024 | 2 000 | 1 362 | 0,07 | 1,125 % éch. 17/06/2024 | 32 100 | 31 386 | 1,69 | \$ 11 000 | 10 622 | 0,57 | |
| 4,915 % éch. 26/03/2024 | 1 000 | 682 | 0,04 | Total Îles Caïmans | | | | 4,875 % éch. 16/01/2024 | | | |
| Transurban Queensland Finance Pty. Ltd. | | | | | | | | 8 812 | 8 807 | 0,48 | |
| 6,413 % éch. 16/12/2024 | 1 570 | 1 080 | 0,06 | | | | | 10 340 | 10 271 | 0,55 | |
| Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd. | | | | | | | | | | | |
| 4,898 % éch. 23/08/2024 | 3 000 | 2 041 | 0,11 | | | | | | | | |
| Total Australie | | 19 476 | 1,05 | | | | | | | | |
| CANADA | | | | DANEMARK | | | | TOTAL IRLANDE | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | ISRAËL | | | |
| National Bank of Canada | | | | Danske Bank A/S | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 3,750 % éch. 09/01/2025 | \$ 800 | 793 | 0,04 | 0,976 % éch. 10/09/2025 | | | | Israel Electric Corp. Ltd. | | | |
| ÎLES CAÏMANS | | | | 3,244 % éch. 20/12/2025 | | | | 5,000 % éch. 12/11/2024 | | | |
| TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | 3,773 % éch. 28/03/2025 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Atlas Senior Loan Fund Ltd. | | | | 5,375 % éch. 12/01/2024 | | | | Aozora Bank Ltd. | | | |
| 6,745 % éch. 15/01/2031 | 3 203 | 3 207 | 0,17 | | | | | 1,050 % éch. 09/09/2024 | | | |
| Carlyle U.S. CLO Ltd. | | | | Total Danemark | | | | 26 300 | | | |
| 6,835 % éch. 15/01/2030 | 999 | 999 | 0,05 | | | | | 25 451 | 1,37 | | |
| Catamaran CLO Ltd. | | | | FINLANDE | | | | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | | | |
| 6,774 % éch. 22/04/2030 | 1 080 | 1 081 | 0,06 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 6,801 % éch. 12/09/2025 | | | |
| CBAM Ltd. | | | | Nordea Bank Abp | | | | 7,023 % éch. 18/07/2025 | | | |
| 6,684 % éch. 17/04/2031 | 2 904 | 2 900 | 0,16 | 6,376 % éch. 06/06/2025 | | | | 9 100 | | | |
| 6,797 % éch. 20/10/2029 | 5 922 | 5 926 | 0,32 | | | | | 9 137 | 0,49 | | |
| CIFC Funding Ltd. | | | | FRANCE | | | | Mizuho Financial Group, Inc. | | | |
| 6,710 % éch. 24/04/2030 | 11 160 | 11 137 | 0,60 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | 2,839 % éch. 16/07/2025 | | | |
| Crestline Denali CLO Ltd. | | | | Cars Alliance Auto Leases France | | | | Nomura Holdings, Inc. | | | |
| 6,797 % éch. 20/01/2030 | 4 038 | 4 038 | 0,22 | 4,503 % éch. 21/10/2038 | | | | 1,851 % éch. 16/07/2025 | | | |
| Dryden CLO Ltd. | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | 2,648 % éch. 16/01/2025 | | | |
| 6,705 % éch. 15/07/2031 | 641 | 641 | 0,03 | BNP Paribas S.A. | | | | ORIX Corp. | | | |
| Dryden Senior Loan Fund | | | | 3,375 % éch. 09/01/2025 | | | | 3,250 % éch. 04/12/2024 | | | |
| 6,555 % éch. 15/04/2029 | 443 | 442 | 0,02 | \$ 9 100 | | | | Panasonic Holdings Corp. | | | |
| Elevation CLO Ltd. | | | | 4,705 % éch. 10/01/2025 | | | | 2,679 % éch. 19/07/2024 | | | |
| 6,885 % éch. 15/10/2029 | 2 581 | 2 585 | 0,14 | 12 000 | | | | Renesas Electronics Corp. | | | |
| 6,935 % éch. 15/07/2029 | 1 051 | 1 052 | 0,06 | 6,124 % éch. 28/02/2024 | | | | 1,543 % éch. 26/11/2024 | | | |
| Greenwood Park CLO Ltd. | | | | AUD 1 800 | | | | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | |
| 6,665 % éch. 15/04/2031 | 7 618 | 7 625 | 0,41 | 6,237 % éch. 14/01/2025 | | | | 5,402 % éch. 16/10/2024 | | | |
| Nassau Ltd. | | | | Société Générale S.A. | | | | 6,796 % éch. 13/01/2026 | | | |
| 6,805 % éch. 15/10/2029 | 233 | 233 | 0,01 | 2,625 % éch. 16/10/2024 | | | | 9 700 | | | |
| Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. | | | | 2,625 % éch. 22/01/2025 | | | | 9 700 | | | |
| 6,788 % éch. 19/10/2031 | 20 250 | 20 275 | 1,09 | 3,875 % éch. 28/03/2024 | | | | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. | | | |
| Octagon Investment Partners Ltd. | | | | 6,425 % éch. 21/01/2026 | | | | 0,850 % éch. 25/03/2024 | | | |
| 6,615 % éch. 16/04/2031 | 283 | 283 | 0,02 | | | | | | | | |
| 6,625 % éch. 15/04/2031 | 474 | 474 | 0,03 | Total France | | | | Total Japon | | | |
| Octagon Loan Funding Ltd. | | | | | | | | | | | |
| 6,809 % éch. 18/11/2031 | 5 640 | 5 647 | 0,30 | | | | | | | | |
| OZLM Ltd. | | | | ALLEMAGNE | | | | MULTINATIONALES | | | |
| 6,675 % éch. 15/04/2031 | 1 200 | 1 199 | 0,06 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| 6,734 % éch. 17/01/2031 | 1 953 | 1 952 | 0,11 | Deutsche Bank AG | | | | Broadcom Corp. | | | |
| 6,827 % éch. 20/01/2031 | 401 | 402 | 0,02 | 0,898 % éch. 28/05/2024 (f) | | | | 3,625 % éch. 15/01/2024 | | | |
| Palmer Square CLO Ltd. | | | | 3,700 % éch. 30/05/2024 | | | | 8 226 | | | |
| 6,794 % éch. 17/01/2031 | 779 | 780 | 0,04 | 3,961 % éch. 26/11/2025 | | | | 8 219 | | | |
| Sound Point CLO Ltd. | | | | Total Allemagne | | | | PAYS-BAS | | | |
| 6,807 % éch. 18/04/2031 | 4 600 | 4 596 | 0,25 | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| Steele Creek CLO Ltd. | | | | Black Diamond CLO DAC | | | | ABN AMRO Bank NV | | | |
| 6,744 % éch. 21/04/2031 | 2 635 | 2 639 | 0,14 | 4,982 % éch. 15/05/2032 | | | | 6,575 % éch. 13/10/2026 | | | |
| Tralee CLO Ltd. | | | | BNPP AM Euro CLO DAC | | | | Enel Finance International NV | | | |
| 6,997 % éch. 20/07/2029 | 369 | 370 | 0,02 | 4,565 % éch. 15/04/2031 | | | | 2,650 % éch. 10/09/2024 | | | |
| Venture CLO Ltd. | | | | Carlyle Euro CLO DAC | | | | 4,250 % éch. 15/06/2025 | | | |
| 6,535 % éch. 15/04/2027 | 2 539 | 2 539 | 0,14 | 4,665 % éch. 15/01/2031 | | | | 6,800 % éch. 14/10/2025 | | | |
| 6,631 % éch. 07/09/2030 | 1 339 | 1 337 | 0,07 | Contego CLO DAC | | | | ING Groep NV | | | |
| 6,777 % éch. 20/01/2029 | 3 093 | 3 094 | 0,17 | 4,642 % éch. 23/01/2030 | | | | 6,442 % éch. 01/04/2027 | | | |
| | | 87 453 | 4,71 | Harvest CLO DAC | | | | 7,076 % éch. 28/03/2026 | | | |
| | | | | Oak Hill European Credit Partners DAC | | | | JDE Peet's NV | | | |
| | | | | 4,733 % éch. 20/10/2031 | | | | 0,800 % éch. 24/09/2024 | | | |
| | | | | Palmer Square European Loan Funding DAC | | | | LeasePlan Corp. NV | | | |
| | | | | 4,695 % éch. 15/07/2031 | | | | 2,875 % éch. 24/10/2024 | | | |
| | | | | 4,745 % éch. 15/04/2031 | | | | Total Pays-Bas | | | |
| | | | | Tikehau CLO DAC | | | | 56 197 | | | |
| | | | | 4,844 % éch. 04/08/2034 | | | | 3,03 | | | |
| | | | | 15 000 | | | | NORVÈGE | | | |
| | | | | 16 378 | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | 0,88 | | | | DNB Bank ASA | | | |
| | | | | | | | | 2,968 % éch. 28/03/2025 | | | |
| | | | | | | | | 2 700 | | | |
| | | | | | | | | 2 683 | | | |
| | | | | | | | | 0,14 | | | |
| | | | | | | | | ARABIE SAOUDITE | | | |
| | | | | | | | | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| | | | | | | | | Saudi Arabian Oil Co. | | | |
| | | | | | | | | 1,625 % éch. 24/11/2025 | | | |
| | | | | | | | | 2 200 | | | |
| | | | | | | | | 2 073 | | | |
| | | | | | | | | 0,11 | | | |

Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|--|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|
| SINGAPOUR | | | | TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES | | | | DESCRIPTION | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX | | | | | | | |
| DBS Group Holdings Ltd. 5,701 % éch. 22/11/2024 | \$ 3 400 | \$ 3 394 | 0,18 | Canada Square Funding PLC 6,000 % éch. 17/06/2058 | £ 4 854 | 6 159 | 0,33 | SLM Student Loan Trust 6,102 % éch. 27/12/2038 | 973 | 959 | 0,05 |
| CORÉE DU SUD | | | | | | | | 6,196 % éch. 25/10/2029 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | 6,496 % éch. 25/07/2023 | | | |
| Korea Southern Power Co. Ltd. 5,312 % éch. 30/10/2024 | AUD 5 300 | 3 611 | 0,20 | Eurohome UK Mortgages PLC 5,490 % éch. 15/06/2044 | 226 | 285 | 0,02 | 7,296 % éch. 25/07/2023 | 139 | 139 | 0,01 |
| SK Hynix, Inc. 1,000 % éch. 19/01/2024 | \$ 12 804 | 12 778 | 0,69 | Great Hall Mortgages PLC 5,489 % éch. 18/06/2038 | 7 | 9 | 0,00 | SMB Private Education Loan Trust | | | |
| 3,000 % éch. 17/09/2024 | 600 | 590 | 0,03 | Lanebrook Mortgage Transaction PLC 6,320 % éch. 12/06/2057 | 2 529 | 3 231 | 0,17 | 2,340 % éch. 15/09/2034 | 1 375 | 1 343 | 0,07 |
| Total Corée du Sud | | 16 979 | 0,92 | Precise Mortgage Funding PLC 6,126 % éch. 16/10/2056 | 1 193 | 1 520 | 0,08 | 2,820 % éch. 15/10/2035 | 2 653 | 2 557 | 0,14 |
| ESPAGNE | | | | | | | | 3,600 % éch. 15/01/2037 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | 3,630 % éch. 15/11/2035 | | | |
| Banco Santander S.A. 3,892 % éch. 24/05/2024 | 7 900 | 7 847 | 0,43 | Residential Mortgage Securities PLC 6,470 % éch. 20/06/2070 | 107 | 137 | 0,01 | 6,226 % éch. 15/10/2035 | 1 521 | 1 511 | 0,08 |
| 5,742 % éch. 30/06/2024 | 6 900 | 6 899 | 0,37 | Stratton Mortgage Funding PLC 6,069 % éch. 25/09/2051 | 4 909 | 6 257 | 0,34 | 6,226 % éch. 15/11/2035 | 1 380 | 1 368 | 0,07 |
| Total Espagne | | 14 746 | 0,80 | 6,121 % éch. 20/07/2060 | 13 456 | 17 151 | 0,92 | 6,926 % éch. 17/02/2032 | 48 | 48 | 0,00 |
| SUPRANATIONALES | | | | | | | | SoFi Professional Loan Program LLC 2,650 % éch. 25/09/2040 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | Structured Asset Investment Loan Trust 6,020 % éch. 25/09/2034 | | | |
| Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0,650 % éch. 10/02/2026 | 10 000 | 9 240 | 0,50 | Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | 513 | 655 | 0,04 | 7,195 % éch. 25/11/2035 | 1 654 | 1 642 | 0,09 |
| SUÈDE | | | | | | | | 62 880 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | 3,39 | | | |
| Swedbank AB 6,787 % éch. 15/06/2026 | 8 500 | 8 612 | 0,46 | Tudor Rose Mortgages 5,820 % éch. 20/06/2048 | 3 128 | 3 967 | 0,21 | OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | |
| SUISSE | | | | | | | | 3M Co. | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | 5,939 % éch. 14/02/2024 | | | |
| Credit Suisse AG 3,625 % éch. 09/09/2024 | 2 000 | 1 973 | 0,11 | Total Royaume-Uni | | 165 772 | 8,94 | 8 400 | 8 397 | 0,45 | |
| 4,750 % éch. 09/08/2024 | 1 000 | 994 | 0,05 | ÉTATS-UNIS | | | | AbbVie, Inc. | | | |
| 5,779 % éch. 02/02/2024 | 2 000 | 1 999 | 0,11 | TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS | | | | 3,850 % éch. 15/06/2024 | | | |
| UBS AG 5,212 % éch. 30/07/2025 | AUD 7 225 | 4 919 | 0,27 | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,682 % éch. 25/03/2034 | \$ 20 | 19 | 0,00 | Ally Financial, Inc. | | | |
| UBS Group AG 6,976 % éch. 12/05/2026 | \$ 15 000 | 15 073 | 0,81 | 6,595 % éch. 25/03/2035 | 250 | 248 | 0,01 | 3,875 % éch. 21/05/2024 | 300 | 298 | 0,02 |
| Total Suisse | | 24 958 | 1,35 | College Avenue Student Loans LLC 7,120 % éch. 26/11/2046 | 838 | 842 | 0,04 | 5,125 % éch. 30/09/2024 | 12 700 | 12 605 | 0,68 |
| ÉMIRATS ARABES UNIS | | | | | | | | American Electric Power Co., Inc. 2,031 % éch. 15/03/2024 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | 12 866 | | | |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 5,483 % éch. 18/02/2025 | AUD 1 040 | 709 | 0,04 | Commonbond Student Loan Trust 2,730 % éch. 25/10/2040 | 329 | 307 | 0,02 | 12 762 | | | |
| ROYAUME-UNI | | | | | | | | 0,69 | | | |
| OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS | | | | | | | | American Tower Corp. | | | |
| Barclays PLC 3,932 % éch. 07/05/2025 | \$ 15 500 | 15 395 | 0,83 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 6,025 % éch. 25/06/2036 | 6 | 6 | 0,00 | 3,375 % éch. 15/05/2024 | 9 000 | 8 918 | 0,48 |
| 6,515 % éch. 26/06/2024 | AUD 2 750 | 1 887 | 0,10 | 6,970 % éch. 25/10/2034 | 488 | 482 | 0,03 | 4,000 % éch. 01/06/2025 | 3 300 | 3 244 | 0,18 |
| HSBC Bank PLC 5,786 % éch. 28/09/2024 | \$ 2 200 | 2 204 | 0,12 | EFS Volunteer LLC 6,446 % éch. 25/10/2035 | 46 | 46 | 0,00 | Athene Global Funding 0,950 % éch. 08/01/2024 | | | |
| HSBC Holdings PLC 4,180 % éch. 09/12/2025 | 3 297 | 3 253 | 0,17 | EquiFirst Mortgage Loan Trust 8,470 % éch. 25/10/2034 | 582 | 558 | 0,03 | 2,514 % éch. 08/03/2024 | 1 300 | 1 292 | 0,07 |
| 6,863 % éch. 11/03/2025 | 15 500 | 15 527 | 0,84 | Finance America Mortgage Loan Trust 6,295 % éch. 25/08/2034 | 733 | 692 | 0,04 | 6,108 % éch. 24/05/2024 | 14 200 | 14 190 | 0,77 |
| 7,008 % éch. 12/09/2026 | 2 820 | 2 847 | 0,15 | First NLC Trust 5,540 % éch. 25/08/2037 | 227 | 113 | 0,01 | 6,398 % éch. 08/01/2024 | 2 084 | 2 084 | 0,11 |
| Imperial Brands Finance PLC 3,125 % éch. 26/07/2024 | 17 926 | 17 635 | 0,95 | Fremont Home Loan Trust 6,205 % éch. 25/01/2035 | 187 | 182 | 0,01 | Bank of America Corp. 0,976 % éch. 22/04/2025 | | | |
| Lloyds Banking Group PLC 3,870 % éch. 09/07/2025 | 17 000 | 16 843 | 0,91 | Home Equity Asset Trust 6,415 % éch. 25/06/2034 | 497 | 491 | 0,03 | 1,843 % éch. 04/02/2025 | 5 000 | 4 981 | 0,27 |
| 5,750 % éch. 07/03/2025 | AUD 2 360 | 1 613 | 0,09 | Long Beach Mortgage Loan Trust 6,445 % éch. 25/04/2035 | 886 | 874 | 0,05 | 3,458 % éch. 15/03/2025 | 4 800 | 4 778 | 0,26 |
| Nationwide Building Society 0,550 % éch. 22/01/2024 | \$ 560 | 558 | 0,03 | MASTR Asset-Backed Securities Trust 6,170 % éch. 25/09/2034 | 796 | 733 | 0,04 | 6,053 % éch. 04/02/2025 | 800 | 800 | 0,04 |
| NatWest Group PLC 4,269 % éch. 22/03/2025 | 8 200 | 8 172 | 0,44 | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 6,520 % éch. 25/09/2033 | 565 | 562 | 0,03 | 6,766 % éch. 02/04/2026 | 4 400 | 4 410 | 0,24 |
| NatWest Markets PLC 6,196 % éch. 29/09/2026 | 535 | 527 | 0,03 | Navient Private Education Loan Trust 6,196 % éch. 15/12/2059 | 2 889 | 2 869 | 0,15 | Baxter International, Inc. 5,853 % éch. 29/11/2024 | | | |
| 6,880 % éch. 22/03/2025 | 8 900 | 8 960 | 0,48 | 6,926 % éch. 16/07/2040 | 2 168 | 2 177 | 0,12 | 4,875 % éch. 15/07/2026 | 7 450 | 7 326 | 0,40 |
| Standard Chartered PLC 6,337 % éch. 23/11/2025 | 9 100 | 9 056 | 0,49 | 7,076 % éch. 15/10/2031 | 4 895 | 4 905 | 0,26 | Black Hills Corp. | | | |
| 7,176 % éch. 30/03/2026 | \$ 12 000 | \$ 12 058 | 0,65 | 7,626 % éch. 15/12/2045 | 335 | 337 | 0,02 | 1,037 % éch. 23/08/2024 | 6 000 | 5 826 | 0,31 |
| | | 116 535 | 6,28 | Navient Student Loan Trust 7,176 % éch. 15/11/2030 | 5 910 | 5 929 | 0,32 | BOC Aviation USA Corp. 1,625 % éch. 29/04/2024 | | | |
| | | | | Nelnet Student Loan Trust 6,052 % éch. 27/02/2051 | 838 | 833 | 0,04 | 300 | 296 | 0,02 | |
| | | | | NovaStar Mortgage Funding Trust 2,907 % éch. 25/01/2036 | 567 | 557 | 0,03 | Brighthouse Financial Global Funding 6,127 % éch. 12/04/2024 | | | |
| | | | | RAAC Trust 7,570 % éch. 25/05/2044 | 1 336 | 1 288 | 0,07 | 5 000 | 4 932 | 0,27 | |
| | | | | SBA Tower Trust 3,869 % éch. 15/10/2049 | 3 000 | 2 950 | 0,16 | Broadcom, Inc. 3,625 % éch. 15/10/2024 | | | |
| | | | | SLC Student Loan Trust 5,665 % éch. 15/05/2029 | 660 | 658 | 0,03 | Cantor Fitzgerald LP 4,875 % éch. 01/05/2024 | | | |
| | | | | SLM Private Credit Student Loan Trust 5,936 % éch. 15/06/2039 | \$ 5 559 | \$ 5 356 | 0,29 | Capital One Financial Corp. 6,746 % éch. 09/05/2025 | | | |
| | | | | 5,976 % éch. 15/06/2039 | 5 110 | 4 953 | 0,27 | Charter Communications Operating LLC 7,289 % éch. 01/02/2024 | | | |
| | | | | | | | | Citibank N.A. 6,461 % éch. 04/12/2026 | | | |
| | | | | | | | | Citigroup, Inc. 4,140 % éch. 24/05/2025 | | | |
| | | | | | | | | Daimler Truck Finance North America LLC 6,167 % éch. 13/12/2024 | | | |
| | | | | | | | | Energy Transfer LP 4,250 % éch. 01/04/2024 | | | |
| | | | | | | | | 5 000 | | | |
| | | | | | | | | 4 982 | | | |
| | | | | | | | | 3 000 | | | |
| | | | | | | | | 2 989 | | | |
| | | | | | | | | 6 488 | | | |
| | | | | | | | | 6 487 | | | |
| | | | | | | | | 0,35 | | | |

Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | JUSTE VALEUR (en milliers) | EN % DE L'ACTIF NET | DESCRIPTION | ACTIONS (en milliers) | JUSTE VALEUR | EN % DE L'ACTIF NET |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|------------------------------|---|-----------------------|-----------------|------------------------------|
| BONS DU TRÉSOR HONGROIS | | | | FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF | | | |
| 10,900 % éch. | | | | PIMCO Select Funds plc - | | | |
| 04/01/2024 (b)(c) | HUF 1 409 000 | \$ 4 070 | 0,22 | Fonds PIMCO US Dollar | | | |
| | | | | Short-Term Floating NAV | 6 725 | \$ 67 | 0,00 |
| | | | | Fund (e) | | | |
| BONS DU TRÉSOR JAPONAIS | | | | EXCHANGE-TRADED FUNDS | | | |
| (0,207) % éch. | | | | PIMCO ETFs plc - Fonds | | | |
| 05/02/2024 (b)(c) | ¥ 2 520 000 | 17 877 | 0,96 | PIMCO US Dollar Short | 1 849 322 | 184 415 | 9,95 |
| Total des Instruments à court terme | | 50 640 | 2,73 | Maturity UCITS ETF (e) | | | |
| | | | | | | | |
| Total des Valeurs mobilières | \$ 1 683 085 | | 90,76 | Total des Fonds d'investissement | | \$ 184 482 | 9,95 |

CONTRATS DE MISE EN PENSION

| Contrepartie | Taux prêteur | Date de règlement | Date d'échéance | Montant du principal | Garanti par | Garantie (reçue) | Contrats de mise en pension, à la valeur | Produits des Contrats de mise en pension à recevoir ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|---------------------------------------|--------------|-------------------|-----------------|----------------------|-----------------------------|------------------|--|--|---------------------|
| FICC | 2,600 % | 29/12/2023 | 02/01/2024 | \$ 4 561 | Billets du Trésor américain | \$ (4 652) | \$ 4 561 | \$ 4 562 | 0,25 |
| | | | | | 4,875 % éch. 30/11/2025 | | | | |
| Total des Contrats de mise en pension | | | | | | \$ (4 652) | \$ 4 561 | \$ 4 562 | 0,25 |

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

| Description | Type | Mois d'expiration | Nbre de Contrats | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|-------|-------------------|------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars | Court | 06/2025 | 882 | \$ (1 654) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars | Court | 03/2024 | 708 | (1 404) | (0,08) |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars | Long | 03/2024 | 46 | 124 | 0,01 |
| Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars | Court | 03/2024 | 61 | (216) | (0,01) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 10 ans ultra mars | Court | 03/2024 | 67 | (381) | (0,02) |
| Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme ultra mars | Court | 03/2024 | 20 | (258) | (0,02) |
| | | | | \$ (3 789) | (0,20) |
| Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé | | | | \$ (3 789) | (0,20) |

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION⁽¹⁾

| Indices/Tranches | Taux fixe (à payer) | Date d'échéance | Montant notionnel ⁽²⁾ | Plus-value/ (moins-value) latente | En % de l'actif net |
|--|---------------------|-----------------|----------------------------------|-----------------------------------|---------------------|
| Indice CDX.IG-41 Index à 5 ans | (1,000) % | 20/12/2028 | \$ 175 300 | \$ (1 273) | (0,07) |
| Total des Instruments financiers dérivés compensés | | | | \$ (1 273) | (0,07) |

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| AZD | 01/2024 | AUD | 62 049 | \$ 41 167 | \$ 0 | \$ (1 179) | (0,07) |
| BOA | 01/2024 | £ | 1 604 | 2 037 | 0 | (8) | 0,00 |
| | 02/2024 | CAD | 1 000 | 747 | 0 | (12) | 0,00 |
| BPS | 01/2024 | £ | 6 115 | 7 757 | 0 | (39) | 0,00 |

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| | 01/2024 | HUF 212 774 | \$ 605 | \$ 0 | \$ (10) | \$ (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 346 | € 1 210 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 1 003 | £ 785 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | HUF 533 026 | \$ 1 520 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 03/2024 | \$ 55 | ILS 199 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| DUB | 02/2024 | CAD 2 000 | \$ 1 493 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| GLM | 01/2024 | \$ 1 036 | £ 813 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2024 | 15 | MXN 262 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| JPM | 01/2024 | HUF 540 467 | \$ 1 541 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | 38 716 | 110 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 2 076 | CAD 2 810 | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| MYI | 01/2024 | € 27 | \$ 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2024 | HUF 79 166 | 225 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| TOR | 02/2024 | ¥ 2 520 000 | 17 030 | 0 | (932) | (932) | (0,05) |
| UAG | 01/2024 | € 86 600 | 95 257 | 0 | (428) | (428) | (0,02) |
| | 01/2024 | £ 33 226 | 42 048 | 0 | (310) | (310) | (0,02) |
| | | | | \$ 57 | \$ (3 000) | \$ (2 943) | (0,16) |

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | € 1 445 | \$ 1 581 | \$ 0 | \$ (15) | \$ (15) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 1 683 | € 1 529 | 7 | (1) | 6 | 0,00 |
| CBK | 01/2024 | 3 023 | 2 758 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| MBC | 01/2024 | € 846 | \$ 925 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 01/2024 | \$ 34 126 | € 31 039 | 169 | 0 | 169 | 0,01 |
| MYI | 01/2024 | 34 007 | 30 940 | 179 | 0 | 179 | 0,01 |
| SCX | 01/2024 | € 8 556 | \$ 9 231 | 0 | (223) | (223) | (0,01) |
| UAG | 01/2024 | \$ 34 033 | € 30 940 | 153 | 0 | 153 | 0,01 |
| | | | | \$ 533 | \$ (249) | \$ 284 | 0,02 |

Au 31 décembre 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

| Contrepartie | Mois de règlement | Devise à livrer | Devise à recevoir | Plus-value latente | (Moins-value) latente | Plus-value/ (moins-value) latente nette | En % de l'actif net |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|---|---------------------|
| BPS | 01/2024 | \$ 86 | £ 68 | \$ 1 | \$ 0 | \$ 1 | 0,00 |
| BRC | 01/2024 | 1 | 1 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| SCX | 01/2024 | 87 | 69 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 01/2024 | 87 | 69 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 | 0,00 |

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (2 657) (0,14)

Total des Investissements

\$ 1 864 409 100,55

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (10 203) (0,55)

Actifs nets

\$ 1 854 206 100,00

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,32 %) :

| Description de l'émetteur | Coupon | Date d'échéance | Date d'achat | Coût | Juste valeur | En % de l'actif net |
|---------------------------|---------|-----------------|-------------------------|----------|--------------|---------------------|
| Deutsche Bank AG | 0,898 % | 28/05/2024 | 31/03/2022 - 31/05/2023 | \$ 5 506 | \$ 5 510 | 0,30 |

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 43 306 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2023.

Un montant en numéraire de 9 098 \$ (31 décembre 2022 : 16 350 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2023.

Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

Un montant en numéraire de 3 460 \$ (31 décembre 2022 : 1 780 \$) a été nanté en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. au 31 décembre 2023.

Évaluations de la juste valeur⁽¹⁾

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2023 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 682 857 | \$ 228 | \$ 1 683 085 |
| Fonds d'investissement | 67 | 184 415 | 0 | 184 482 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 4 561 | 0 | 4 561 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | (7 719) | 0 | (7 719) |
| Totaux | \$ 67 | \$ 1 864 114 | \$ 228 | \$ 1 864 409 |

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

| Catégorie ⁽²⁾ | Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1) | Autres données significatives observables (Niveau 2) | Données significatives non observables (Niveau 3) | Juste valeur |
|---|---|--|---|---------------------|
| Valeurs mobilières | \$ 0 | \$ 1 891 711 | \$ 0 | \$ 1 891 711 |
| Fonds d'investissement | 62 | 225 956 | 0 | 226 018 |
| Contrats de mise en pension | 0 | 154 472 | 0 | 154 472 |
| Instruments financiers dérivés ⁽³⁾ | 0 | 4 760 | 0 | 4 760 |
| Totaux | \$ 62 | \$ 2 276 899 | \$ 0 | \$ 2 276 961 |

⁽¹⁾ Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

⁽²⁾ Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

⁽³⁾ Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2023 :

| Contrepartie | Taux d'emprunt | Date de règlement | Date d'échéance | Montant emprunté | À payer sur Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos ⁽¹⁾ | En % de l'actif net |
|--|----------------|-------------------|-----------------|------------------|--|---------------------|
| BPG | 5,600 % | 19/12/2023 | 02/01/2024 | \$ (32 265) | \$ (32 279) | (1,74) |
| MSC | 5,550 | 19/12/2023 | 02/01/2024 | (11 609) | (11 615) | (0,63) |
| Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | | | \$ (43 894) | (2,37) |

⁽¹⁾ Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 7 \$ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse établie par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Contrepartie | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|--------------|--|-------------------------|-----------------------------------|--|-------------------------|-----------------------------------|
| | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ | Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote | Garantie (reçue)/nantie | Expositions nettes ⁽¹⁾ |
| AZD | \$ (1 179) | \$ 1 230 | \$ 51 | \$ 1 566 | \$ (1 460) | \$ 106 |
| BOA | (20) | 0 | (20) | (2 159) | 1 770 | (389) |
| BPS | (66) | 0 | (66) | 131 | 0 | 131 |
| BRC | (3) | 0 | (3) | (17) | 0 | (17) |
| CBK | 6 | 0 | 6 | 1 487 | (1 350) | 137 |
| DUB | (24) | 0 | (24) | (4) | 0 | (4) |
| GLM | 2 | 0 | 2 | S/O | S/O | S/O |
| JPM | (21) | 0 | (21) | 350 | (290) | 60 |
| MBC | 211 | (390) | (179) | (153) | 0 | (153) |
| MYI | 175 | (370) | (195) | (2) | 10 | 8 |
| SCX | (222) | 280 | 58 | 2 590 | (2 250) | 340 |
| SSB | 1 | 0 | 1 | S/O | S/O | S/O |
| TOR | (932) | 870 | (62) | S/O | S/O | S/O |
| UAG | (585) | 1 080 | 495 | (101) | 0 | (101) |

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, veuillez vous reporter à la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle | 48,81 | 43,64 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé* | 41,02 | 38,19 |
| Autres valeurs mobilières | 0,93 | 0,05 |
| Fonds d'investissement | 9,95 | 9,78 |
| Contrats de mise en pension | 0,25 | 6,69 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | (0,20) | 0,04 |
| Instruments financiers dérivés compensés | (0,07) | 0,01 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | (0,14) | 0,16 |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | (2,37) | S/O |

* Selon la liste des marchés en Annexe 1 au Prospectus qui répondent aux critères des marchés réglementés par les exigences OPCVM.

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 :

| Investissements à la juste valeur | 31 décembre 2023 (%) | 31 décembre 2022 (%) |
|--|----------------------|----------------------|
| Australie | 1,05 | 1,66 |
| Belgique | S/O | 0,39 |
| Bermudes | S/O | 0,39 |
| Canada | 0,04 | S/O |
| Îles Caïmans | 6,85 | 3,83 |
| Danemark | 0,58 | 0,66 |
| Finlande | 0,15 | 0,38 |
| France | 2,89 | 2,56 |
| Allemagne | 1,13 | 1,17 |
| Irlande | 6,41 | 5,43 |
| Israël | 0,63 | 0,35 |
| Italie | S/O | 0,22 |
| Japon | 4,78 | 5,03 |
| Luxembourg | S/O | 0,10 |
| Multinationales | 0,44 | S/O |
| Pays-Bas | 3,03 | 3,03 |
| Norvège | 0,14 | 0,04 |
| Arabie saoudite | 0,11 | 0,11 |
| Singapour | 0,18 | 0,07 |
| Corée du Sud | 0,92 | 0,84 |
| Espagne | 0,80 | 0,42 |
| Supranationales | 0,50 | 1,10 |
| Suède | 0,46 | S/O |
| Suisse | 1,35 | 1,42 |
| Émirats arabes unis | 0,04 | 0,08 |
| Royaume-Uni | 8,94 | 8,42 |
| États-Unis | 46,61 | 42,70 |
| Instruments à court terme | 2,73 | 1,48 |
| Fonds d'investissement | 9,95 | 9,78 |
| Contrats de mise en pension | 0,25 | 6,69 |
| Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé | | |
| Contrats à terme standardisés | (0,20) | 0,04 |
| Instruments financiers dérivés compensés | | |
| Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection | (0,07) | 0,01 |
| Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base | S/O | 0,00 |
| Instruments financiers dérivés hors cote | | |
| Contrats de change à terme | (0,16) | (0,11) |
| Contrats de change à terme couverts | 0,02 | 0,27 |
| Autres actifs et passifs à court terme | (0,55) | 1,44 |
| Actifs nets | 100,00 | 100,00 |

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES

Chaque Fonds (appelé individuellement un « Fonds » et collectivement les « Fonds ») présenté dans ce rapport est un compartiment de PIMCO Funds: Global Investors Series plc (la « Société »), société à capital variable à compartiments multiples et responsabilité séparée entre les Fonds, immatriculée sous le numéro 276928 en vertu de la loi irlandaise de 2014 sur les sociétés (Companies Act) et agréée par la Banque centrale d'Irlande (la « Banque centrale »), conformément au Règlement de la Communauté européenne (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2011 (S.I. N° 352 de 2011), tel que modifié (le « Règlement OPCVM »). La Société est à compartiments multiples et constituée de différents Fonds, comprenant chacun une ou plusieurs catégories d'actions (les « Catégories »). Le Conseil d'administration de la Société (le « Conseil » ou les « Administrateurs ») peut, à son entière discrétion, émettre plusieurs catégories d'actions (« Catégorie ») pour un même Fonds. Un portefeuille d'actifs distinct est maintenu pour chaque Fonds et investi conformément aux objectifs et politiques d'investissement applicables pour ce Fonds. Le Conseil peut créer périodiquement des Fonds supplémentaires après accord préalable écrit de la Banque centrale. La Société a été constituée le 10 décembre 1997.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (le « Gestionnaire ») est le gestionnaire de la Société.

Comme prévu dans le Prospectus de la Société, Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd et PIMCO Europe GmbH (chacun un « Conseiller en investissement ») ont été nommés en tant que conseiller en investissement pour divers Fonds de la Société. PIMCO Asia Limited et PIMCO Asia Pte Ltd. (chacun, un conseiller en investissement) ont été validés par la Banque centrale pour agir en tant que conseiller en investissement pour les fonds irlandais.

Conformément au Prospectus de la Société, chaque Conseiller en investissement peut déléguer la gestion discrétionnaire des investissements des Fonds à un ou plusieurs conseillers en investissement par délégation, sous réserve de toutes les exigences légales et réglementaires applicables. Lorsqu'un Conseiller en investissement est nommé pour un ou des Fonds spécifique(s), le Conseiller en investissement nommé chacun des autres Conseillers en investissement, PIMCO Asia Limited et PIMCO Asia Pte Ltd., comme conseillers en investissement par délégation pour ce ou ces Fonds spécifique(s). Les commissions de chaque conseiller en investissement par délégation ainsi nommé seront payées par le Gestionnaire ou par les Conseillers en investissement au nom du Gestionnaire et prélevées sur les Frais de gestion.

Le siège social de la Société est sis au 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irlande.

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Ci-après figure une synthèse des principales méthodes comptables et des techniques d'estimation adoptées par la Société et appliquées dans le cadre de la préparation des présents états financiers :

(a) Base de préparation

Les états financiers sont préparés conformément à la norme FRS 102 (« FRS 102 »), « La norme de présentation de l'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » émise par la Financial Reporting Council, à la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et à la Réglementation sur les OPCVM. Les états financiers sont établis selon le principe de la continuité d'exploitation pour l'ensemble des Fonds.

Les Administrateurs estiment que les informations qui doivent figurer dans l'État global des bénéfices et pertes comptabilisés et dans le Rapprochement des mouvements des fonds des actionnaires sont présentées dans le Compte de résultat et dans l'État de l'évolution des actifs nets.

La Société a fait usage de l'exemption offerte aux fonds communs de placement qui détiennent une proportion considérable d'investissements hautement liquides et évalués à la juste valeur en vertu de la Section 7 de la norme FRS 102 et ne présente pas d'état des flux de trésorerie.

Les états financiers sont dressés selon la méthode du coût historique, telle que modifiée par la réévaluation des éléments d'actif et de passif financiers détenus à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

La Société tient des comptes distincts pour chaque Fonds. La Société émet des Actions et les affecte au Fonds choisi par l'actionnaire. Les produits d'une émission et les revenus qui en découlent sont crédités à chaque Catégorie de chaque Fonds proportionnellement à la valeur totale de chaque Catégorie. Lors

d'un rachat, les actionnaires n'ont droit qu'à la fraction qui leur revient des actifs nets du Fonds au titre des actions émises en leur faveur.

La Société a adopté le dollar américain comme devise de présentation. Les états financiers de chaque Fonds sont préparés dans la devise fonctionnelle du Fonds respectif. En vertu de la loi irlandaise sur les sociétés, les totaux des Fonds pour la Société sont présentés en dollar américain, qui est la devise de l'environnement économique principal de la Société. Tous les montants sont exprimés en dollar américain, sauf indication contraire. Les états financiers des Fonds individuels sont convertis en dollar américain et sont cumulés pour la préparation des états financiers de la Société.

Le Bilan de la Société est converti à l'aide des taux de change à la clôture de l'exercice, et le Compte de résultat et l'État de l'évolution des actifs nets de la Société sont convertis à un taux de change moyen (une approximation des taux actuels) de l'exercice pour inclusion dans les états financiers de la Société.

Les plus-values ou moins-values de change sur la conversion des actifs nets à l'ouverture de l'exercice de la Société, et la différence moyenne de taux découlant de la conversion du Compte de résultat et de l'État de l'évolution des actifs nets de la Société, sont comprises dans l'État de l'évolution des actifs nets de la Société. L'ajustement de conversion n'a aucun impact sur les actifs nets affectés aux Fonds individuels.

Tous les montants ont été arrondis au millier le plus proche, sauf indication contraire. Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Le Tableau des investissements de certains Fonds peut détenir des valeurs mobilières ayant une valeur nominale nulle et une juste valeur nulle lorsque les montants réels de valeur nominale et de juste valeur sont arrondis au millier le plus proche.

(b) Détermination de la Valeur Nette d'Inventaire

La Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») de chaque Fonds et/ou chaque Catégorie est calculée à la clôture des négociations normales chaque Jour de négociation tel qu'indiqué dans le dernier Prospectus de la Société ou dans le supplément pertinent.

La Société a opté pour l'application des dispositions relatives à la comptabilisation et à l'évaluation visées dans la norme IAS (International Accounting Standard) n° 39 intitulée Instruments financiers : comptabilisation et évaluation et des obligations de communication et de présentation de la norme FRS 102 pour rendre compte de ses instruments financiers. Conformément à la norme IAS 39, les titres détenus dans le Fonds et ses autres éléments d'actif sont évalués sur la base du cours moyen ou du dernier cours au 31 décembre 2023 afin de déterminer les actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables (les « Actifs nets »).

(c) Transactions sur titres et produits de placement

Les transactions sur titres sont comptabilisées à la date de transaction à des fins d'informations financières. Les titres achetés ou vendus avant l'émission ou à livraison différée peuvent être réglés après la période de règlement habituelle pour le titre après la date de transaction. Les plus-values et moins-values réalisées sur des titres vendus sont comptabilisées selon la méthode du coût identifié. Les produits de dividendes sont comptabilisés à la date ex-dividende, à l'exception de certains dividendes de titres étrangers dont la date ex-dividende peut être échue ; ils seront alors comptabilisés dès que le Fonds est informé de la date ex-dividende. Le produit des intérêts, ajusté pour accroissement des décotes et amortissement des primes, est comptabilisé selon le principe de comptabilité d'exercice à compter de la date de règlement et calculé selon la méthodologie de détermination de l'intérêt réel, à l'exception des titres ayant une date d'entrée en vigueur différée, auquel cas le produit des intérêts est comptabilisé selon le principe de comptabilité d'exercice à compter de la date d'entrée en vigueur. Pour les titres convertibles, les primes attribuables à la conversion ne sont pas amorties. Les gains (pertes) de remboursement sur les titres liés à des créances hypothécaires et autres titres adossés à des actifs, le cas échéant, sont comptabilisés comme des composants des produits des intérêts au Compte de résultat.

Des titres de créance peuvent être classés comme prêts improductifs et les produits des intérêts correspondants peuvent être réduits par l'arrêt de la comptabilisation des intérêts courants et la sortie du bilan des intérêts à recevoir lorsque le recouvrement de tout ou partie des intérêts est devenu douteux au vu des procédures appliquées régulièrement. Un titre de créance cesse d'être considéré comme un prêt improductif lorsque son émetteur reprend le paiement des intérêts ou lorsque la recouvrabilité des intérêts redevient probable.

Le revenu est comptabilisé brut de toute retenue d'impôt non remboursable/non recouvrable et net de tout crédit d'impôt. La retenue à la source est présentée séparément au Compte de résultat. Les Fonds peuvent être assujettis à des taxes imposées par certains pays sur les plus-values en capital sur la cession de placements. Les impôts sur les plus-values sont comptabilisés selon la comptabilité d'engagement et sont présentés séparément au Compte de résultat.

(d) Affectations à catégories multiples et Catégories d'Actions couvertes

Sauf indication contraire, chacune des Catégories d'un Fonds proposées par la Société dispose des mêmes droits en termes d'actifs et de privilèges de vote (si l'on exclut le fait que les actionnaires d'une Catégorie disposent de droits de vote exclusifs sur les questions liées uniquement à cette Catégorie). Dans chaque Catégorie de chaque Fonds, la Société peut émettre des Actions de distribution (Actions donnant droit aux bénéficiaires), des Actions de capitalisation (Actions donnant lieu à la capitalisation des bénéficiaires) et/ou des Actions de distribution II (Actions cherchant à distribuer un rendement amélioré). Cette structure à catégories multiples permet aux investisseurs de choisir la méthode d'acquisition d'actions qui leur convient le mieux, en fonction du montant de l'achat, de la durée de détention prévue des actions et d'autres critères. Lorsqu'une émission couvre des Actions de Catégories ou de types différents, la Valeur Nette d'Inventaire par action peut varier d'une Catégorie à l'autre, du fait que les revenus sont cumulés ou distribués, ou que les frais et commissions diffèrent. Les plus-values et moins-values réalisées et latentes de chaque Fonds sont affectées chaque jour à chaque Catégorie d'actions, au prorata des actifs nets de chaque Catégorie du Fonds concerné.

S'agissant des catégories d'actions couvertes (les « Catégories couvertes »), la Société prévoit de se couvrir contre les fluctuations des devises des Catégories couvertes par rapport aux autres devises, sous réserve des réglementations et des interprétations que la Banque centrale promulgue en tant que de besoin. Les Catégories couvertes ne peuvent faire l'objet d'un effet de levier du fait de ces opérations. Bien que la Société s'efforce de couvrir le risque de change, il ne saurait être garanti qu'elle y parviendra. Les opérations de couverture sont clairement rattachées à une Catégorie spécifique. Tous les coûts et gains/(pertes) de telles stratégies de couverture peuvent réduire sensiblement les avantages des actionnaires de la Catégorie couverte concernée si la devise de cette Catégorie chute par rapport à la devise fonctionnelle et/ou à la devise dans laquelle la totalité ou une partie des actifs du Fonds concerné est libellée et couverte contre d'autres devises.

(e) Transactions en devise étrangère

Les états financiers de chaque Fonds sont présentés dans la devise de l'environnement économique principal sur lequel il opère (la « devise fonctionnelle »). Les Fonds de la Société ont tous la même devise fonctionnelle et la même devise de présentation.

En vertu de la loi irlandaise sur les sociétés, les totaux des Fonds pour la Société sont présentés en dollar américain, qui est la devise de l'environnement économique principal de la Société.

Les justes valeurs des titres, des positions de change et des autres éléments d'actif et passif étrangers sont converties dans la devise fonctionnelle de chaque Fonds, sur la base des taux de change en vigueur chaque jour ouvrable. Les fluctuations de la valeur des positions de change et des autres éléments d'actif et passif, qui résultent d'une fluctuation des taux de change, sont comptabilisées comme des plus ou moins-values latentes sur devises étrangères.

Les plus-values ou moins-values latentes découlant de la conversion de titres libellés dans une devise étrangère sont comptabilisées dans la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit et les plus-values ou moins-values latentes découlant de la conversion d'instruments financiers dérivés libellés dans une devise étrangère sont comptabilisées dans la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés dans le Compte de résultat.

Les plus-values et moins-values de change découlant de la vente de titres libellés dans une devise étrangère sont comptabilisées dans la Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit et les plus-values et moins-values de change découlant de la vente d'instruments financiers dérivés libellés dans une devise étrangère sont inclus dans la Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés dans le Compte de résultat.

Les plus-values et moins-values réalisées entre une date de transaction et une date de règlement sur des acquisitions et des ventes de titres libellés dans des

devises étrangères et d'instruments financiers dérivés sont comptabilisées en Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change dans le Compte de résultat.

Certains Fonds, qui comportent une Catégorie couverte, concluent des contrats de change à terme destinés à compenser l'effet de la couverture au niveau du Fonds afin que la devise fonctionnelle soit exposée uniquement aux devises autres que la devise fonctionnelle.

(f) Frais de transaction

Les frais de transaction sont des frais encourus pour acquérir des actifs et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat. Ils comprennent les commissions et frais versés aux mandataires, conseillers, courtiers et négociants. Les frais de transaction figurent au Compte de résultat aux postes Plus-value/(moins-value) nette réalisée et Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit, et Plus-value/(moins-value) nette réalisée et Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés. Pour les titres à revenu fixe et certains instruments dérivés, les frais de transaction ne sont pas identifiables séparément du prix d'achat du titre et ne peuvent donc pas être divulgués séparément.

(g) Péréquation

La Société applique la pratique comptable appelée péréquation du revenu. L'ajustement effectué au nom de la péréquation des revenus assure que la distribution des revenus entre les actionnaires ayant investi dans des catégories d'actions de distribution et de distribution II est proportionnelle à la période durant laquelle un tel investissement a eu lieu. Un montant égal à la part du prix d'émission par action qui reflète le revenu net (le cas échéant) accumulé mais non distribué jusqu'à la date d'émission des actions sera réputé constituer un paiement de péréquation et traité comme remboursé à l'actionnaire concerné (i) au rachat de ces actions avant le paiement du premier dividende correspondant ou (ii) lors du paiement du premier dividende auquel l'actionnaire avait droit au cours de la même période comptable que celle pendant laquelle les actions sont émises. Le paiement de tout dividende subséquent au paiement du premier dividende donné ou le rachat desdites actions subséquent au paiement du premier dividende sera réputé inclure le revenu net (le cas échéant) cumulé mais non versé jusqu'à la date du rachat ou de la déclaration de dividende concernés.

(h) Estimations comptables et jugements critiques

La préparation des états financiers en conformité avec la norme FRS 102 impose aux Administrateurs de formuler des avis, des estimations et des hypothèses qui ont une incidence sur l'application des normes comptables et sur les montants déclarés de l'actif, du passif, des produits et des charges. Les résultats réels peuvent être différents de ces estimations. Les estimations et les hypothèses sous-jacentes sont constamment examinées. Les modifications apportées aux estimations comptables sont imputées à la période au cours de laquelle les estimations sont révisées et aux périodes suivantes concernées.

(i) Valeur Nette d'Inventaire ajustée

La Valeur Nette d'Inventaire ajustée (ou *Swing Pricing*) peut faire office de mécanisme efficace pour protéger les actionnaires contre l'éventuel impact dilutif que peuvent entraîner les coûts de transaction élevés associés à des entrées ou sorties nettes importantes. Conformément aux Statuts, les titres sous-jacents d'un Fonds cotés ou négociés sur un marché réglementé sont généralement évalués et valorisés en fonction du prix moyen ou du dernier prix négocié à la clôture. Toutefois, ces titres sont négociés en fonction des cours acheteur et vendeur. Plus il y aura d'écart entre ces cours acheteur et vendeur, plus l'impact sur l'évaluation d'un Fonds sera important.

La Valeur Nette d'Inventaire est ajustée en recalculant à la hausse ou à la baisse la Valeur Nette d'Inventaire (VNI) par action en fonction d'un facteur d'ajustement dépendant de l'orientation des flux de trésorerie nets d'un Fonds donné. Ce facteur d'ajustement correspond au montant, défini par les Administrateurs, permettant d'ajuster la VNI par action à la hausse ou à la baisse afin de tenir compte des frais de transaction (tels que les charges fiscales et autres coûts et frais) qui seraient à payer sur l'acquisition ou la cession effective des actifs du Fonds concerné. Dans des conditions de marché normales, le facteur d'ajustement ne dépasse pas 2 % de la VNI par action initiale de tout Fonds. Toutefois, dans des circonstances de marché exceptionnelles, ce niveau peut monter jusqu'à 5 % maximum afin de protéger les intérêts des actionnaires. La VNI ajustée sera ensuite appliquée à toute souscription ou tout rachat reçu le Jour de négociation concerné. Les entrées nettes importantes entraînent un ajustement à la hausse de la VNI par action, et les sorties nettes importantes un ajustement à la baisse.

Notes relatives aux États financiers (suite)

La Société procède à un ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire lorsque les flux de trésorerie nets dépassent un seuil préalablement fixé par les Administrateurs, au-delà duquel ils estiment que le montant de la dilution causée par les coûts de transactions serait important pour le Fonds.

S'il y a ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire, cela se fera au niveau du Fonds et non au niveau de la Catégorie concernée, car les coûts de transactions sont encourus au niveau du Fonds.

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, un ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire avait été appliqué au Fonds Income Fund II.

La VNI par action est indiquée à la Note 19 et peut inclure un ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire. Les ajustements de la Valeur Nette d'Inventaire sont comptabilisés dans le Bilan, dans le Compte de résultat et dans l'État de l'évolution des actifs nets.

3. INVESTISSEMENTS À LA JUSTE VALEUR ET HIÉRARCHIE DE LA JUSTE VALEUR

Cette catégorie est composée de deux sous-catégories : actifs et passifs financiers désignés par la direction à leur juste valeur par le biais du compte de résultat lors du lancement, et ceux détenus pour négociation. Les actifs et passifs financiers comptabilisés à leur juste valeur par le biais du compte de résultat lors du lancement sont des instruments financiers qui ne sont pas classés comme détenus à des fins de négociation mais qui sont gérés, et leur performance est évaluée sur une base de juste valeur conformément à la stratégie d'investissement documentée du Fonds. Les actifs ou passifs financiers détenus à des fins de négociation sont acquis ou encourus principalement aux fins de la vente ou de les racheter à court terme. Les produits dérivés sont considérés comme étant détenus à des fins de négociation.

(a) Politiques d'évaluation des investissements

La politique des Fonds impose aux Conseillers en investissement (ou « PIMCO ») et au Conseil d'administration d'évaluer les informations relatives à ces actifs et passifs financiers à la juste valeur parallèlement à d'autres informations financières liées.

Les plus et moins-values découlant des variations de juste valeur des actifs et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont incluses dans le Compte de résultat de l'exercice au cours de laquelle ils surviennent.

Les titres et autres actifs des Fonds pour lesquels des cotations de marché sont immédiatement disponibles sont évalués à leur juste valeur. La juste valeur est généralement déterminée sur la base des prix de clôture officiels ou des derniers prix de vente rapportés, ou s'il n'y en a pas, en fonction de cotations obtenues auprès de teneurs de marchés établis ou de prix (y compris des évaluations de prix) fournis par des services de cotation approuvés du Fonds, des systèmes de reporting de cotation et d'autres sources tierces (collectivement, les « Services de cotation »).

Les investissements initialement évalués en devises autres que la devise fonctionnelle du Fonds sont convertis en appliquant les taux de change obtenus auprès des services de cotations. Par conséquent, la VNI des actions du Fonds peut être affectée par les changements de valeur des devises par rapport à la devise fonctionnelle du Fonds. La valeur des titres négociés sur des marchés étrangers ou libellés dans des devises autres que la devise fonctionnelle du Fonds peut être largement influencée un jour où la bourse concernée n'est pas ouverte aux négociations et la VNI peut varier les jours où un investisseur n'est pas en mesure d'acheter, racheter ou échanger des actions.

Si la valeur d'un titre négocié uniquement sur une bourse étrangère a changé de manière substantielle après la clôture de la bourse principale ou du marché principal pour ce titre mais avant la clôture du jour de négociation, le titre sera alors valorisé à sa juste valeur sur la base des procédures établies et approuvées par le Conseil. Les titres qui ne sont pas négociés quand un Fonds est ouvert sont aussi valorisés à leur juste valeur. Un Fonds peut déterminer la juste valeur d'investissements sur la base d'informations fournies par les Services de cotation ou des tierces parties qui peuvent recommander des prix basés sur la juste valeur ou des ajustements en référence avec d'autres titres, indices ou actifs. Si des prix basés sur la juste valeur sont requis et en déterminant les justes valeurs, un Fonds peut, parmi d'autres éléments, prendre en compte des événements significatifs (notamment des changements dans la valeur de titres ou d'indices sur titres) qui ont eu lieu après la clôture du marché pertinent et avant la fin du jour de négociation. Un Fonds peut recourir à des outils de modélisation fournis par des prestataires tiers pour déterminer la juste valeur des titres concernés par des événements importants. Les opérations de change peuvent permettre de négocier des titres étrangers lorsque la Société n'est pas ouverte pour les négociations, ce qui pourrait avoir un effet sur les investissements du Fonds si le Fonds est dans

l'impossibilité d'acheter ou de vendre des actions. Les Fonds ont retenu des Services de cotation afin de déterminer la juste valeur de titres étrangers. Ce service utilise des statistiques et des programmes basés sur la performance historique des marchés et d'autres statistiques économiques afin de contribuer à l'estimation des justes valeurs. Les estimations de justes valeurs utilisées par un Fonds pour des titres étrangers peuvent différer des valeurs réalisées lors de la vente de ces titres et la différence peut être significative dans les états financiers. Les prix de juste valeur peuvent impliquer des jugements subjectifs concernant la valeur d'un titre ou d'un autre actif, et les justes valeurs utilisées afin de déterminer la VNI d'un Fonds peuvent différer des prix cotés ou publiés, ou des prix utilisés par d'autres pour de mêmes investissements. De plus, l'utilisation de prix de juste valeur peut ne pas toujours entraîner des ajustements du prix des titres ou autres actifs détenus par un Fonds.

(b) Hiérarchie de la juste valeur

La Société doit divulguer la hiérarchie de la juste valeur dans laquelle les évaluations de la juste valeur sont catégorisées en ce qui concerne les actifs et les passifs. Les informations reposent sur une hiérarchie de la juste valeur selon trois niveaux pour les données utilisées dans les techniques d'évaluation permettant de calculer la juste valeur.

La juste valeur est définie comme le montant auquel un actif peut être échangé, un passif réglé ou un instrument de fonds propres octroyé peut être échangé entre parties informées et disposées à contracter dans des conditions de pleine concurrence. La divulgation d'une hiérarchie de la juste valeur doit être faite distinctement pour chaque grande catégorie d'actifs et de passifs et classe les évaluations de la juste valeur selon trois niveaux (Niveaux 1, 2 et 3). Les données ou la méthode utilisées ne représentent pas nécessairement une indication du risque associé à l'investissement dans ces titres. Les niveaux 1, 2 et 3 de la hiérarchie de la juste valeur sont les suivants :

- Niveau 1 — Cotations de marchés actifs ou de bourses de valeurs concernant des éléments d'actifs et de passif identiques.
- Niveau 2 — Autres données significatives observables y compris, sans s'y limiter, des cotations concernant des éléments d'actif ou de passif similaires de marchés actifs, des cotations concernant des éléments d'actif ou de passif identiques ou similaires de marchés non actifs, des données autres que des cotations observables pour les éléments d'actif ou de passif (comme les taux d'intérêt, les courbes de taux, les volatilités, les remboursements anticipés, les sévérités des pertes, les risques de crédit et les taux de défaillance) ou toute autre donnée corroborée par le marché.
- Niveau 3 — Données significatives non observables basées sur les meilleures informations disponibles compte tenu de la situation, si les données observables ne sont pas disponibles, y compris les hypothèses du Conseil, ou de personnes agissant selon ses instructions, qui servent à déterminer la juste valeur des investissements.

(c) Techniques d'évaluation et hiérarchie de la juste valeur

Les méthodes d'évaluation (ou « techniques ») et les données significatives utilisées pour déterminer les justes valeurs des instruments financiers classés en Niveau 1 et Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur sont les suivantes :

Les titres à revenu fixe, dont les obligations et billets d'entreprises, convertibles et municipaux, les obligations d'agences américaines, les obligations du Trésor américain, les émissions souveraines, les prêts bancaires, les titres privilégiés convertibles, les obligations non américaines et les titres de créance à court terme (tels que les billets de trésorerie, les dépôts à terme et les certificats de dépôt) sont habituellement valorisés sur la base de cotations obtenues de courtiers et négociants ou sur la base de Services de cotation qui utilisent les cotations des courtiers-négociants, les échanges communiqués ou les évaluations estimées selon leurs modèles internes de cotation. Les modèles internes des Services de cotation utilisent des données observables comme les renseignements concernant les émetteurs, les taux d'intérêt, les courbes de taux, les remboursements anticipés, les risques/écarts de crédit, les taux de défaillance et les cotations d'actifs similaires. Les titres pour lesquels on utilise des techniques d'évaluation et des données similaires à celles précitées appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Certains titres à revenu fixe achetés sur une base de livraison différée ou en tant qu'engagement de rachat dans le cas d'une opération par vente et rachat dos-à-dos ou d'une opération de prise en pension, sont valorisés quotidiennement à la valeur de marché jusqu'à ce qu'ils soient réglés à la date de règlement à terme et classés au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les titres adossés à des créances hypothécaires ou à des actifs sont généralement émis sous la forme de tranches ou catégories de titres séparées, dans le cadre de chaque opération. Ces titres sont habituellement évalués par des Services de cotation qui ont recours aux cotations des courtiers-négociants ou aux évaluations estimées par leurs modèles internes d'évaluation

Pour ces titres, ces modèles prennent habituellement en compte les attributs des niveaux des tranches, les données actuelles du marché, les flux de trésorerie estimés et les écarts basés sur les rendements de chaque tranche. Ils intègrent également la performance des garanties associées à la transaction, lorsque celle-ci est disponible. Les titres liés à des créances hypothécaires et ceux adossés à des actifs auxquels on applique des techniques d'évaluation similaires et les données précitées appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les actions ordinaires, les ETF, les billets négociés en bourse et les instruments financiers dérivés, tels que les contrats à terme standardisés, les droits et les bons de souscription, ou les options sur contrats à terme standardisés qui sont négociés sur une bourse de valeurs nationale, sont indiqués au dernier prix de vente ou de règlement déclaré le jour de leur évaluation. Si ces titres font l'objet d'échanges actifs et qu'aucun ajustement de l'évaluation n'est pratiqué, ils appartiennent au Niveau 1 de la hiérarchie de la juste valeur.

Il est possible de pratiquer des ajustements de certains titres négociés uniquement sur une bourse de valeurs étrangère pour tenir compte des mouvements du marché entre la clôture du marché étranger et celle de la Bourse de New York. Ces titres sont valorisés sur la base de Services de cotation qui tiennent compte de la corrélation entre les modèles de négociation des valeurs étrangères données et les échanges intrajournaliers sur les marchés américains des investissements. Les titres qui font l'objet d'ajustements d'évaluation appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur. Les titres privilégiés et autres actions négociés sur des marchés non actifs ou valorisés par référence à des instruments similaires appartiennent également au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Des ajustements d'évaluation peuvent être appliqués à certains contrats à terme standardisés et options négociés en bourse pour tenir compte des fluctuations du marché entre le règlement de la bourse et la clôture du NYSE. Ces titres sont évalués à l'aide de cotations obtenues à partir d'un système de cotation, de teneurs de marché établis ou de Services de cotation. Les instruments financiers dérivés qui font l'objet de ces ajustements d'évaluation appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les investissements dans des sociétés d'investissement à capital variable enregistrées (autres que des ETF) sont valorisés sur la base de la VNI des investissements et appartiennent au Niveau 1 de la hiérarchie de la juste valeur. Les investissements dans des sociétés d'investissement à capital variable non enregistrées sont calculés par rapport à la VNI de ces investissements. Ils appartiennent au Niveau 1, sous réserve que la VNI soit observable, calculée quotidiennement et corresponde à la valeur à laquelle les achats et les ventes seront réalisés.

La valeur des instruments financiers dérivés hors cote, comme les contrats de change à terme, les contrats d'options ou les contrats de swaps, provient des prix des actifs, des indices, des taux de référence et autres données sous-jacents ou d'une combinaison de ces facteurs. Ces contrats sont normalement valorisés selon les cotations des courtiers-négociants ou les données des Services de cotation. Selon le produit et les modalités de la transaction, la valeur des contrats d'instruments financiers dérivés peut être estimée par des Services de cotation qui ont recours à un ensemble de données observées sur les marchés réglementés actifs, comme les renseignements afférents aux émetteurs, les indices, les écarts, les taux d'intérêt, les courbes, les dividendes et les taux de change. Les instruments financiers dérivés évalués selon des techniques d'évaluation et des données similaires à celles précitées appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

La valeur des options sur actions négociées en bourse et des instruments financiers dérivés hors cote, comme les contrats de change à terme et les contrats d'options, provient des prix des actifs, des indices, des taux de référence et autres données sous-jacents ou d'une combinaison de ces facteurs. Ces contrats sont normalement valorisés en fonction de cotations obtenues à partir d'un système de reporting de cotation, de teneurs de marchés établis ou de Services de cotation (normalement définis à la clôture de la Bourse de New York). En fonction du produit et des modalités de la transaction, les instruments financiers dérivés peuvent être évalués par les Services de cotation en appliquant un ensemble de techniques, y compris des modèles de simulation d'évaluation. Les modèles d'évaluation utilisent des données observées sur les marchés réglementés actifs, tels que les cours cotés, les informations sur les émetteurs, les indices, les écarts entre les cours acheteurs et vendeurs, les taux d'intérêt, les volatilités implicites, les courbes de taux, les dividendes et les taux de change. Les instruments financiers dérivés qui utilisent des techniques et des données d'évaluation similaires à celles décrites ci-dessus relèvent du Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

La valeur des swaps compensés et des swaps hors cote provient des prix des actifs, des indices, des taux de référence et autres données sous-jacents ou d'une combinaison de ces facteurs. Ils sont valorisés sur la base de cotations obtenues de courtiers-négociants ou sur la base des prix de marché fournis par les Services de cotation (habituellement déterminés à la clôture de la Bourse de New York). Les swaps compensés et les swaps hors cote peuvent être évalués par les Services de cotation en appliquant un ensemble de techniques, y compris

des modèles de simulation d'évaluation. Les modèles d'évaluation utilisent les données observées sur les marchés réglementés actifs comme le taux de swap au jour le jour, le taux LIBOR à terme, les taux d'intérêt, les courbes de taux et les écarts de crédit. Ces titres appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Actifs et passifs négociables de Niveau 3 à la juste valeur Quand une méthode d'évaluation de la juste valeur est appliquée par PIMCO et utilise des données significatives non observables, une méthode que le Conseil ou les personnes agissant sur ses ordres estiment refléter la juste valeur sera utilisée pour évaluer les investissements et ceux-ci seront classés au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur. Les techniques d'évaluation et les données significatives utilisées pour déterminer les justes valeurs des actifs et instruments financiers du Fonds classés au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur sont les suivantes :

Les processus d'évaluation par procuration fixent le prix de base d'un titre à revenu fixe et ajustent ensuite le prix proportionnellement aux variations de la juste valeur d'un titre prédéterminé dont la durée est jugée comparable, généralement un bon du Trésor américain ou un billet d'État en fonction du pays d'émission. Le prix de base peut être une cotation d'un courtier-négociant, un prix de transaction ou une valeur interne dérivée de l'analyse des données de marché. Le prix de base peut être réactualisé périodiquement en fonction de la disponibilité des données de marché et des procédures approuvées par le Comité de surveillance des évaluations (Valuation Oversight Committee). Des évolutions importantes des données non observables du processus d'évaluation par procuration (le prix de base) entraîneraient des changements proportionnels et directs de la juste valeur du titre. Ces titres appartiennent au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur.

Si le prix du fournisseur évalué par un tiers n'est pas disponible ou n'est pas considéré comme indicatif de la juste valeur, le Conseiller en investissement peut choisir d'obtenir des cotations directement auprès d'un courtier-négociant ou transmises par un fournisseur tiers. Dans le cas où la juste valeur est basée sur la cotation d'un seul courtier, ces titres sont classés au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur. Les cotations de courtiers sont généralement reçues de participants au marché établis. Le Conseiller en investissement n'a aucune transparence pour consulter les données sous-jacentes qui soutiennent les cours de marché, même si elles sont reçues indépendamment. Des modifications importantes de la cotation du courtier auraient un effet direct et proportionnel sur la juste valeur du titre.

L'évaluation du recouvrement attendu estime que la juste valeur d'un actif existant peut être recouvrée, nette de tout passif. Des modifications importantes des données non observables auraient un effet direct et proportionnel sur la juste valeur du titre. Ces titres appartiennent au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur.

L'évaluation de l'instrument de référence estime la juste valeur en utilisant la corrélation du titre à un ou plusieurs titres diversifiés, des indices de marché, et/ou des instruments financiers, dont les informations de prix sont disponibles immédiatement. Les données non observables peuvent comprendre celles utilisées dans les algorithmes basés sur le changement de pourcentage dans les instruments de référence et/ou les pondérations de chaque instrument de référence. Des modifications importantes des données non observables auraient un effet direct et proportionnel sur la juste valeur du titre. Ces titres appartiennent au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les titres de créance à court terme tels que les billets de trésorerie, les dépôts à terme et les certificats de dépôt ayant une maturité résiduelle de 60 jours maximum peuvent être évalués selon la méthode du coût amorti, tant que la valeur au coût amorti de tels titres de créance à court terme est approximativement la même que la juste valeur du titre telle que déterminée sans l'utilisation de l'évaluation au coût amorti. Ces titres appartiennent au Niveau 2 ou au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur en fonction de la source du prix de base.

4. TITRES ET AUTRES INVESTISSEMENTS

(a) Liquidités

Les liquidités sont évaluées à leur valeur nominale majorée des intérêts courus, le cas échéant. Tous les soldes bancaires des liquidités sont détenus soit par State Street Bank and Trust Co. ou directement auprès d'un dépositaire par délégation.

(b) Investissements dans des Fonds centraux

Certains Fonds peuvent également investir dans le Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, un compartiment de PIMCO Select Funds plc, dans le cadre de leurs opérations de gestion de trésorerie. Les principaux investissements du Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund sont des instruments du marché monétaire et des instruments à revenu fixe à court terme. Le Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund peut supporter des frais liés à ses activités d'investissement, mais les Fonds n'investissent que dans la Catégorie Z et ne payent donc aucuns Frais de gestion.

(c) Investissements dans des titres

Les Fonds peuvent avoir recours aux investissements et stratégies décrits ci-dessous dans les limites fixées par les politiques d'investissement des Fonds.

Transactions à livraison différée Certains Fonds achètent ou vendent parfois des titres à livraison différée. Ces transactions impliquent l'engagement d'un Fonds à acheter ou vendre des titres à un prix ou un rendement prédéterminé, le paiement et la livraison ayant lieu après la période de règlement d'usage. Lorsque des transactions à livraison différée sont en cours, le Fonds affecte ou reçoit en garantie des liquidités en quantité suffisante pour couvrir le prix d'achat ou les obligations concernées. Lors de l'achat d'un titre à livraison différée, le Fonds assume les droits et risques liés à la propriété du titre, y compris les risques de fluctuations de prix et de rendement, et prend ces fluctuations en compte pour déterminer sa Valeur Nette d'Inventaire. Un Fonds peut céder ou renégocier une transaction à livraison différée après sa conclusion, ce qui peut entraîner une plus-value ou une moins-value. Lorsqu'un Fonds vend un titre à livraison différée, il ne participe pas aux plus-values et moins-values ultérieures afférentes au titre en question.

Fonds négociés en bourse Certains Fonds peuvent investir dans des fonds négociés en bourse (exchange-traded fund ou « ETF »), qui sont typiquement des sociétés d'investissement basées sur un indice qui détiennent substantiellement tous leurs actifs dans des titres représentant leur indice spécifique, mais peuvent également être des sociétés d'investissement gérées activement. Les actions des ETF se négocient toute la journée sur une bourse et représentent un investissement dans un portefeuille de titres et d'actifs. En tant qu'actionnaire d'une autre société d'investissement, le Fonds supporterait sa part au prorata des frais d'investissement de l'autre société, y compris les commissions de conseil, en plus des frais qu'il supporte directement dans le cadre de ses propres opérations.

Obligations indexées sur l'inflation Certains Fonds peuvent investir dans des obligations indexées sur l'inflation qui sont des titres à revenu fixe dont la valeur principale est régulièrement ajustée en fonction du taux d'inflation. Le taux d'intérêt assorti à ces obligations est généralement fixé à l'émission à un niveau inférieur à celui des obligations classiques. Toutefois, les intérêts sont acquittés sur toute la durée de vie d'une obligation indexée sur l'inflation, sur la base de la valeur principale ajustée pour tenir compte de l'inflation. Toute hausse ou baisse du principal d'une obligation indexée sur l'inflation sera considérée comme un produit des intérêts dans le Compte de résultat, même si l'investisseur ne reçoit pas le principal avant l'échéance. Certaines obligations indexées sur l'inflation garantissent le remboursement du principal initial de l'obligation à l'échéance (ajusté en fonction de l'inflation). Dans le cas des obligations qui ne fournissent pas une telle garantie, la valeur du principal ajustée de l'obligation remboursée à l'échéance peut être en dessous de la valeur initiale.

Crédits consortiaux et cessions Certains Fonds investissent parfois dans des titres de créance directs, qui sont des intérêts sur des montants dus par des emprunteurs privés, publics ou autres à des prêteurs ou des syndicats de prêteurs. Les investissements d'un Fonds dans des crédits peuvent prendre la forme de participations dans des crédits ou cessions de tout ou partie de crédits émis par des tiers. Un crédit est souvent administré par une banque ou une autre institution de crédit (le « prêteur ») qui agit en tant qu'agent de tous les porteurs. Le prêteur administre les conditions du crédit en vertu des modalités du contrat de prêt. Un Fonds peut investir dans des séries multiples ou des tranches de prêt qui peuvent comporter différentes modalités et des risques associés différents. Lorsqu'un Fonds achète des cessions à des prêteurs, il acquiert des droits directs sur l'emprunteur. Ces prêts peuvent comprendre des participations à des prêts relais, qui sont des emprunts contractés par des emprunteurs pour une courte période (en général moins d'un an) en attendant la mise en place d'arrangements de financement plus permanents tels que, par exemple, l'émission d'obligations, souvent à rendement élevé et émises afin de réaliser des acquisitions.

Les types de prêts et investissements connexes dans lesquels un Fonds peut investir comprennent, entre autres, les prêts de premier ordre, les prêts subordonnés (en ce compris les prêts de second rang, titrisés [B-Notes] et mezzanine), les prêts complets, les prêts immobiliers commerciaux et autres prêts commerciaux et structurés. Dans le cas de prêts subordonnés, les dettes de rang supérieur à l'obligation de l'emprunteur vis-à-vis du détenteur de ce prêt peuvent être substantielles, même en cas d'insolvabilité de l'emprunteur. Les prêts mezzanine sont généralement garantis par le nantissement d'une participation dans l'emprunteur du crédit hypothécaire propriétaire du bien immobilier plutôt que d'un intérêt dans une créance hypothécaire.

Les investissements dans des prêts peuvent comprendre des engagements de prêt non financés, qui sont des obligations contractuelles de financement. Les engagements de prêts non financés peuvent comprendre des facilités de crédit renouvelables susceptibles d'obliger les Fonds à fournir des liquidités supplémentaires à l'emprunteur sur sa demande. Ces engagements représentent une obligation future totale, même si un pourcentage des montants engagés des prêts ne sera jamais utilisé par l'emprunteur. Lorsqu'il investit dans un crédit

consortial, un Fonds est en droit de percevoir des paiements de principal, d'intérêt et de commissions uniquement de la part du prêteur qui vend le contrat de prêt et uniquement à réception par le prêteur des paiements de l'emprunteur. Un Fonds peut recevoir une commission d'engagement basée sur la partie non tirée de la part de la ligne de crédit sous-jacente d'un prêt à taux variable. Dans certaines circonstances, un Fonds peut recevoir une commission de pénalité lors du remboursement anticipé d'un prêt à taux variable par un emprunteur. Les commissions reçues/payées sont respectivement comptabilisées comme éléments des produits des intérêts ou frais des intérêts dans le Compte de résultat.

Les engagements de prêts non financés au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 sont comptabilisés au passif du Bilan au poste À payer sur investissements achetés.

Titres liés à des créances hypothécaires et autres titres adossés à des actifs

Certains Fonds peuvent investir dans des titres liés à des créances hypothécaires et autres titres adossés à des actifs qui représentent directement ou indirectement une participation dans, ou qui sont garantis et payables par, des prêts sur des actifs immobiliers. Les titres liés à des créances hypothécaires sont créés par des pools de prêts résidentiels ou commerciaux, y compris des prêts hypothécaires accordés par des institutions d'épargne et de crédit, des banques hypothécaires, des banques commerciales et autres. Ces titres prévoient un paiement mensuel composé du paiement des intérêts et du principal. Les intérêts peuvent être déterminés selon des taux fixes ou variables. Le taux de remboursement anticipé des créances hypothécaires sous-jacentes influera sur le prix et la volatilité d'un titre lié à une créance hypothécaire ; il pourra également avoir un effet sur le raccourcissement ou l'allongement de la durée réelle du titre par rapport aux prévisions au moment de l'achat. Le paiement en temps voulu du principal et des intérêts de certains titres liés à des créances hypothécaires est garanti par la bonne foi et le crédit du gouvernement américain. Les pools créés et garantis par des émetteurs non gouvernementaux, y compris les sociétés financières parrainées par le gouvernement, peuvent être supportés par diverses formes d'assurance et de garantie, mais il ne peut être garanti que les assureurs ou les garants privés pourront satisfaire leurs obligations aux termes des polices d'assurance ou des contrats de garantie. L'investissement dans des titres liés à des créances hypothécaires garantis par des prêts hypothécaires commerciaux présente des risques, ceux-ci représentent l'impact des conditions locales et économiques sur le marché de l'immobilier, la capacité des locataires à payer leur loyer et celle d'un bien à attirer et conserver les locataires. Ces titres peuvent être moins liquides et afficher une plus grande volatilité des cours que les autres types de titres liés à des créances hypothécaires ou adossés à des actifs. D'autres titres adossés à des actifs sont créés à partir de différents types d'actifs, y compris les prêts automobiles, les comptes débiteurs, tels que les créances de cartes de crédit et de comptes hospitaliers, les prêts immobiliers, les prêts étudiants, les prêts pour un bateau ou une résidence mobile, les prêts pour un camping-car, les prêts pour des logements préfabriqués, les crédits-baïls d'aéronefs, les crédits-baïls d'ordinateurs et les prêts bancaires syndiqués.

Les Obligations garanties (« CDO ») comprennent les obligations garanties (« CBO »), les prêts garantis (« CLO ») et autres titres de structure similaire. Les CBO et CLO font partie des titres adossés à des actifs. Une CBO est un trust garanti par un pool diversifié de titres à revenu fixe à haut risque, d'une qualité inférieure à « investment grade ». Un CLO est un trust garanti habituellement par un pool de prêts qui peuvent comprendre, entre autres, des prêts garantis de premier ordre nationaux et étrangers, des prêts de premier ordre non garantis et des prêts d'entreprises subordonnés, notamment les prêts dont la notation peut être inférieure à « investment grade » ou des prêts non notés équivalents. Le risque associé à l'investissement dans des CDO dépend essentiellement du type de titres garantis et de la catégorie de CDO dans laquelle le Fonds investit. Les CBO, CLO et autres CDO comportent des risques supplémentaires dont, sans limitation, (i) la possibilité que les distributions afférentes aux titres garantis ne soient pas suffisantes pour verser les intérêts ou autres paiements, (ii) la garantie peut subir une baisse de sa qualité ou être l'objet d'une défaillance, (iii) le Fonds peut investir dans des CBO, CLO ou d'autres CDO subordonnées à d'autres catégories, et (iv) la structure complexe du titre peut ne pas être parfaitement comprise au moment de l'investissement et donner lieu à des litiges avec l'émetteur ou à des résultats d'investissements inattendus.

Obligations hypothécaires garanties Les obligations hypothécaires garanties (« CMO ») sont des titres de créance d'une entité juridique garantis par des prêts hypothécaires entiers ou par des obligations hypothécaires privées et divisées en catégories. Les CMO sont structurées en multiples catégories, appelées souvent « tranches », chacune d'elles ayant une échéance et un calendrier de paiements du principal et des intérêts, y compris les prépaiements, différents. Les CMO peuvent être moins liquides et afficher une plus grande volatilité des cours que les autres types de titres liés à des créances hypothécaires ou adossés à des actifs.

Les titres adossés à des créances hypothécaires à coupon détaché

(« SMBS ») sont des créances hypothécaires dérivées à catégories multiples. Les SMBS sont normalement structurées en deux catégories qui reçoivent des parts différentes des distributions d'intérêts et de principal d'un pool d'actifs hypothécaires. Un SMBS aura une catégorie qui recevra l'ensemble des intérêts (catégorie « intérêts uniquement ») alors que l'autre recevra l'ensemble du principal (catégorie « principal uniquement »). Les paiements reçus pour la catégorie « intérêts uniquement » sont compris dans les produits des intérêts du Compte de résultat. Du fait du solde nul du principal à recevoir à l'échéance d'une catégorie « intérêts uniquement », des ajustements sont apportés tous les mois au coût du titre jusqu'à l'échéance. Ces ajustements sont compris dans le poste produits des intérêts du Compte de résultat. Les paiements reçus pour la catégorie « principal uniquement » viennent en déduction du coût et de la valeur nominale des titres.

Titres à rémunération en nature Certains Fonds peuvent investir dans des titres à rémunération en nature (« PIK »). Les PIK peuvent offrir à l'émetteur l'option, à chaque date de paiement des intérêts, d'effectuer les paiements d'intérêts en numéraire et/ou en titres de créance supplémentaires. Ces titres de créance supplémentaires ont normalement les mêmes caractéristiques, y compris d'échéance, de taux d'intérêt et de risques associés, que les obligations d'origine. Les cotations quotidiennes des obligations d'origine peuvent inclure les intérêts courus (appelées « dirty price ») et figurent au Bilan au poste Actif financier à la juste valeur par résultat sur valeurs mobilières.

Titres émis par des Agences du gouvernement américain ou des entreprises parrainées par le gouvernement américain

Certains Fonds peuvent investir dans des titres d'agences du gouvernement américain ou d'entreprises parrainées par le gouvernement américain. Les titres du gouvernement américain sont des dettes du gouvernement américain, de ses organismes ou organes et, dans certains cas, garantis par ces derniers. Certains titres du gouvernement américain, tels que les bons, les billets et les obligations du Trésor, et les titres garantis par la Government National Mortgage Association (« GNMA » ou « Ginnie Mae »), sont soutenus par la bonne foi et le crédit du gouvernement des États-Unis ; d'autres, tels que ceux des Federal Home Loan Banks, sont soutenus par le droit de l'émetteur d'emprunter auprès du Département du Trésor américain (le « Trésor américain ») ; et d'autres, tels que ceux de la Federal National Mortgage Association (« FNMA » ou « Fannie Mae »), sont soutenus par le pouvoir discrétionnaire du gouvernement américain d'acheter les obligations de l'agence. Les titres du gouvernement américain peuvent comprendre des titres à coupon zéro. Les titres à coupon zéro ne distribuent pas d'intérêts et tendent à être soumis à un risque plus grand que les titres qui paient des intérêts.

Les garants liés au gouvernement (c'est-à-dire non garantis par la bonne foi et le crédit du gouvernement américain) comprennent la FNMA et la Federal Home Loan Mortgage Corporation (« FHLMC » ou « Freddie Mac »). La FNMA est une société parrainée par le gouvernement. La FNMA achète des prêts hypothécaires résidentiels classiques (c'est-à-dire non assurés ou garantis par un organisme du gouvernement) à partir d'une liste de vendeurs/agents serveurs agréés comprenant des associations d'épargne et de prêts agréées par les États ou le gouvernement fédéral, des banques mutuelles d'épargne, des banques commerciales, des sociétés de crédit mutuel et des institutions de crédit foncier. Les titres à flux identique émis par la FNMA sont garantis quant au paiement au moment opportun du principal et des intérêts par la FNMA, mais ne sont pas garantis par la bonne foi et le crédit du gouvernement américain. La FHLMC émet des certificats de participation (« Participation Certificates », PC) qui sont des titres à flux identique, chacun représentant une participation indivise dans un pool de prêts hypothécaires résidentiels. La FHLMC garantit le paiement des intérêts et le recouvrement du principal en temps voulu, mais les PC ne sont pas soutenus par la bonne foi et le crédit du gouvernement américain.

En juin 2019, la FNMA et la FHLMC ont commencé à émettre des titres adossés à des créances hypothécaires uniformes à la place de leurs offres actuelles de titres éligibles TBA (la « Single Security Initiative »). La Single Security Initiative a pour but d'améliorer la liquidité globale du marché TBA et d'uniformiser les caractéristiques des certificats de la FNMA et de la FHLMC. Les effets que la Single Security Initiative peut avoir sur le marché pour les titres TBA et autres titres adossés à des créances hypothécaires sont incertains.

Un Fonds peut recourir à des stratégies de « roll-timing » afin de repousser l'expiration ou l'échéance d'une position comme un titre « to-be-announced » (« TBA ») sur un actif sous-jacent, en fermant la position avant expiration et en ouvrant une nouvelle position assortie d'une date d'expiration plus tardive sur le même actif sous-jacent. Les titres TBA achetés ou vendus figurent à l'actif ou au passif du Bilan, selon le cas.

Sociétés d'investissement immobilier (« Real Estate Investment Trusts » ou « REIT ») Certains Fonds peuvent investir dans des REIT, des véhicules de placements collectifs qui possèdent et généralement exploitent des biens immobiliers générateurs de revenus. Si un REIT remplit certaines conditions, notamment la distribution aux actionnaires de la quasi-totalité des revenus

imposables (autres que des plus-values nettes), il n'est pas imposé sur les revenus distribués aux actionnaires. Les distributions reçues de la part des REIT peuvent être considérées comme des revenus, des plus-values ou un remboursement de capital. Un remboursement de capital est enregistré par le Fonds comme une réduction de la structure de coûts de ses investissements dans le REIT. Les REIT sont assujettis à des frais de gestion et autres et ainsi, dans la mesure où les Fonds investissent dans des REIT, les Fonds assumeront leur part proportionnelle des coûts d'exploitation de ces REIT.

Titres sujets à restrictions Certains Fonds peuvent investir dans des titres dont la revente est soumise à des restrictions légales ou contractuelles. Ils peuvent généralement être vendus de manière privée, mais ils doivent être enregistrés ou dispensés d'enregistrement avant d'être vendus au public. Les titres de placements privés sont généralement considérés comme des titres sujets à restrictions. La cession de titres sujets à restrictions peut impliquer des négociations longues, ainsi que des frais et il peut s'avérer difficile de les vendre rapidement à un prix convenable. Les titres sujets à restrictions détenus par les Fonds au 31 décembre 2023 figurent dans les Notes relatives au Tableau des investissements.

Transactions avant l'émission Certains Fonds achètent ou vendent parfois des titres faisant l'objet de transactions avant l'émission. Ces transactions sont conditionnelles, puisqu'un titre, bien qu'il ait été autorisé, n'a pas encore été émis sur le marché. Les transactions d'achat ou de vente de titres avant leur émission impliquent l'engagement d'un Fonds à acheter ou vendre des titres à un prix ou un rendement prédéterminé, le paiement et la livraison ayant lieu après la période de règlement d'usage. Un Fonds peut vendre des titres avant leur émission avant qu'ils ne soient livrés, ce qui peut entraîner la réalisation d'une plus ou moins-value.

Obligations perpétuelles Certains Fonds peuvent investir dans des obligations perpétuelles, des titres à revenu fixe sans date d'échéance mais qui versent un coupon à perpétuité (sans date de fin ou d'échéance fixée). Contrairement aux titres à revenu fixe classiques, il n'existe aucune obligation pour les obligations perpétuelles de rembourser le principal. Le paiement des coupons est toutefois obligatoire. Bien que les obligations perpétuelles n'aient pas de date d'échéance, elles peuvent avoir une date de remboursement par anticipation à laquelle la perpétuité est supprimée et l'émetteur peut restituer le principal reçu à la date d'achat spécifiée. En outre, une obligation perpétuelle peut avoir des caractéristiques supplémentaires, telles que des hausses de taux d'intérêt à des dates périodiques ou une augmentation à un moment prédéterminé à l'avenir.

Les bons de souscription sont des titres qui sont généralement émis en parallèle à un titre de créance ou un titre privilégié et qui garantissent à leur détenteur le droit d'acheter une quantité proportionnelle d'actions ordinaires à un prix fixé. Les bons de souscription ont normalement une durée de vie mesurée en années et permettent à leur détenteur d'acheter des actions ordinaires d'une société à un prix généralement supérieur au cours du marché au moment de l'émission des bons de souscription. Les bons de souscription peuvent comporter des risques plus importants que certains autres types d'investissements. En général, les bons de souscription ne donnent pas le droit de recevoir des dividendes ou d'exercer des droits de vote eu égard aux titres sous-jacents, et ils n'ouvrent aucun droit sur les actifs de l'émetteur. En outre, leur valeur n'évolue pas forcément selon la valeur des titres sous-jacents, et ils perdent leur valeur s'ils ne sont pas utilisés à leur date d'expiration ou avant celle-ci. Si le cours du marché de l'action sous-jacente ne dépasse pas le prix d'exercice pendant la durée de vie d'un bon de souscription, celui-ci arrivera à expiration en ayant perdu sa valeur. Les bons de souscription peuvent augmenter les bénéfices ou les pertes potentiels d'un investissement par rapport à un investissement du même montant dans les titres sous-jacents. De même, l'augmentation ou la diminution en pourcentage de la valeur d'un bon de souscription sur un titre de capital peut être supérieure à l'augmentation ou à la diminution en pourcentage de la valeur de l'action ordinaire sous-jacente. Les bons de souscription peuvent se rapporter à l'achat de titres de capital ou de créance. Les titres de créance assortis de bons de souscription liés à l'achat de titres de capital partagent de nombreuses caractéristiques avec les titres convertibles. Dans une certaine mesure, leur prix peut refléter la performance de l'action sous-jacente. Des titres de créance peuvent également être assortis de bons de souscription permettant l'achat de titres de créance supplémentaires au même taux de coupon. Une baisse des taux d'intérêt permettrait au Portefeuille de vendre à profit de tels bons de souscription. En revanche, en cas de hausse des taux d'intérêts, ces bons de souscription arriveraient à expiration en ayant perdu toute valeur.

5. EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Les Fonds peuvent contracter des emprunts et conclure d'autres opérations de financement décrites ci-dessous dans la mesure autorisée par les politiques d'investissement des Fonds.

Les paragraphes suivants contiennent des informations sur la capacité des Fonds à prêter ou emprunter des liquidités ou des titres en vertu des réglementations applicables de la Banque centrale et du Prospectus, dans le cadre autorisé par les objectifs et politiques d'investissement des Fonds et sous réserve des limites établies par la Banque centrale de temps à autre et des dispositions du Prospectus, ce qui peut être considéré comme des opérations de financement ou des emprunts par les Fonds. La localisation de ces instruments dans les états financiers du Fonds est décrite ci-dessous :

(a) Contrats de mise en pension

Certains Fonds peuvent conclure des contrats de mise en pension. Selon les termes d'une mise en pension de titres classique, le Fonds prend possession d'un titre obligataire sous-jacent (« garantie ») à la condition que le vendeur s'engage à le racheter et que le Fonds le revende ensuite à un prix et une date convenus. Dans un contrat de mise en pension à échéance ouverte, il n'y a pas de date de rachat prédéterminée et le Fonds ou la contrepartie peuvent résilier le contrat à tout moment. Les titres sous-jacents de tous les contrats de mise en pension sont détenus par le dépositaire ou les dépositaires par délégation désignés du Fonds dans le cadre de contrats de mise en pension tripartites. Dans certains cas, ils resteront sous la garde de la contrepartie. La juste valeur de la garantie doit être égale ou supérieure au montant total des engagements de mise en pension, intérêts compris. Les contrats de mise en pension, y compris les intérêts courus, sont inclus dans le Bilan. Les intérêts perçus sont enregistrés comme éléments des produits des intérêts dans le Compte de résultat. En période de demande accrue de garanties, un Fonds peut payer des frais sur la réception de la garantie, ce qui entraînera des frais des intérêts pour le Fonds.

(b) Contrats de prise en pension

Certains Fonds ont parfois recours à des contrats de prise en pension. Dans un contrat de prise en pension, un Fonds livre un titre à un établissement financier (la contrepartie) en échange de numéraire, et convient simultanément de racheter le même titre ou un titre essentiellement identique à un prix et une date convenus. Dans un contrat de prise en pension à échéance ouverte, il n'y a pas de date de rachat prédéterminée et le Fonds ou la contrepartie peuvent résilier le contrat à tout moment. Un Fonds a droit au paiement du principal et des intérêts, le cas échéant, afférents au titre remis à la contrepartie pendant la durée du contrat. Les espèces reçues en échange des titres livrés, augmentées des paiements d'intérêt courus devant être effectués par le Fonds à des contreparties figurent au passif du Bilan. Les intérêts payés par le Fonds à des contreparties sont enregistrés comme éléments des frais des intérêts dans le Compte de résultat. En période de demande accrue du titre, le Fonds peut recevoir une commission pour son utilisation par la contrepartie, ce qui peut résulter en un produit des intérêts pour le Fonds. Le Fonds différenciera les actifs déterminés comme liquides par les Conseillers en investissement ou couvrira autrement ses obligations au titre des contrats de prise en pension.

(c) Ventes à découvert

Certains Fonds peuvent réaliser des transactions de vente à découvert. Une vente à découvert est une transaction dans laquelle le Fonds vend des titres qu'il ne possède pas en prévision d'un repli de la juste valeur desdits titres. Les titres vendus à découvert et les intérêts dus sur ces titres, le cas échéant, sont comptabilisés au passif du Bilan. Un Fonds est tenu de livrer les titres au cours de marché lors de la couverture de la position à découvert. Les pertes potentielles liées aux ventes à découvert peuvent être illimitées, alors que celles sur les achats ne peuvent être supérieures au montant total investi.

(d) Vente et rachat dos-à-dos

Certains Fonds peuvent conclure des transactions de financement appelées « vente et rachat dos-à-dos ». Dans une transaction de vente et rachat dos-à-dos, un Fonds vend un titre à un établissement financier (la contrepartie), et convient simultanément de racheter le même titre ou un titre essentiellement identique à un prix et une date convenus. Le Fonds n'a pas droit au paiement du principal et des intérêts, le cas échéant, afférents au titre vendu à la contrepartie pendant la durée du contrat. Le produit convenu des titres devant être rachetés par un Fonds figure au passif du Bilan. Le Fonds constate le revenu net représenté par l'écart de prix entre le prix reçu sur le titre transféré et le prix de rachat convenu. On l'appelle généralement « baisse de prix ». Une baisse de prix se compose (i) des ajustements du revenu abandonné des intérêts et de l'inflation que le Fonds aurait éventuellement perçus si le titre n'avait pas été vendu et (ii) des conditions de financement négociées entre le Fonds et la contrepartie. Les ajustements du revenu abandonné des intérêts et de l'inflation, le cas échéant, sont comptabilisés comme des composants des produits des intérêts au Compte de résultat. Les intérêts payés par le Fonds à des contreparties sur la base des conditions de financement négociées sont enregistrés en frais des intérêts dans le Compte de résultat. En période de demande accrue du titre, le Fonds peut recevoir une commission pour son utilisation par la contrepartie, ce qui peut résulter en un produit des intérêts pour le Fonds. Un Fonds effectuera une séparation des actifs

définis comme liquides par les Conseillers en investissement ou couvrira autrement ses obligations au titre des contrats de vente et rachat dos-à-dos.

6. INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

Les paragraphes suivants contiennent des informations sur la façon et la raison pour laquelle les Fonds utilisent des instruments financiers dérivés et l'impact de ces instruments sur la situation financière, le résultat d'exploitation et les flux de trésorerie des Fonds. Les instruments financiers dérivés en cours à la clôture de l'exercice qui figurent dans le Tableau des investissements et les montants des plus-values et moins-values réalisées au cours de la période et les variations des plus-values et moins-values latentes sur les instruments financiers dérivés qui figurent dans le Compte de résultat servent d'indicateurs du volume d'activité des instruments dérivés des Fonds.

(a) Contrats de change à terme

Certains Fonds peuvent conclure des contrats de change à terme dans le cadre du règlement d'achats prévus ou de la vente de titres, afin de couvrir l'exposition aux devises associée à tout ou partie des titres d'un Fonds, ou dans le cadre d'une stratégie d'investissement. Un contrat de change à terme est un accord entre deux parties portant sur la vente ou l'achat d'une devise à un prix défini à une date ultérieure. La juste valeur d'un contrat de change à terme fluctue en fonction de l'évolution des taux de change des devises. Les contrats de change à terme sont évalués quotidiennement à la valeur du marché et l'évolution de la valeur est comptabilisée par un Fonds en tant que plus-value ou moins-value latente. Les plus-values ou moins-values réalisées correspondent à la différence entre la valeur du contrat lors de son ouverture et sa valeur lors de sa clôture. Elles sont comptabilisées à livraison ou réception de la devise. Ces contrats peuvent comporter un risque de marché supérieur à la plus-value ou à la moins-value latente indiquée dans le Bilan. En outre, un Fonds peut être exposé à un risque si les contreparties ne parviennent pas à respecter les dispositions du contrat ou si la valeur de la devise évolue de manière défavorable par rapport à la devise fonctionnelle. Pour atténuer ce risque, des montants en espèces ou des titres peuvent être échangés en garantie conformément aux termes des contrats sous-jacents.

Certains Fonds, qui comportent une catégorie couverte, concluent des contrats de change à terme destinés à compenser l'effet de la couverture au niveau du Fonds afin que la catégorie couverte soit exposée uniquement aux devises autres que la devise fonctionnelle. Il n'existe aucune garantie que ces contrats de change à terme propres à chaque catégorie seront un succès.

En ce qui concerne les catégories couvertes, les plus-values ou moins-values réalisées et latentes sont imputées uniquement aux catégories d'actions correspondantes. Les plus-values ou moins-values latentes se reflètent en tant que composants des instruments financiers dérivés au Bilan. Dans le cadre de ces contrats, les titres peuvent être identifiés en tant que garantie conformément aux conditions des contrats respectifs.

(b) Contrats à terme standardisés

Certains Fonds ont parfois recours à des contrats à terme standardisés. Un Fonds peut recourir à des contrats à terme standardisés afin de gérer son exposition aux marchés des valeurs mobilières ou aux fluctuations des taux d'intérêt et des devises. Les principaux risques associés au recours à des contrats à terme standardisés sont la corrélation imparfaite entre les fluctuations de la juste valeur des titres détenus par un Fonds, les prix des contrats à terme standardisés et l'éventualité d'un marché non liquide. Les contrats à terme standardisés sont évalués à leur cours de règlement journalier coté. Lors de la conclusion d'un contrat à terme standardisé, le Fonds doit effectuer un dépôt auprès du courtier du contrat à terme standardisé. Le dépôt est constitué de liquidités ou d'obligations du gouvernement américain ou d'agences américaines, ou de titres de créance souveraine sélectionnées, conformément aux exigences de marge initiale du courtier ou de la bourse. Les contrats à terme standardisés sont évalués quotidiennement à la valeur du marché et les montants débiteurs ou créditeurs liés à l'évolution de la valeur (« Marge des Instruments financiers dérivés ») sont comptabilisés par le Fonds. Les plus-values et moins-values sont enregistrées, mais elles ne sont pas considérées comme réalisées tant que les contrats n'ont pas expiré ou ne sont pas clôturés. Les contrats à terme standardisés impliquent, à différents degrés, des risques de pertes supérieures à la Marge des Instruments financiers dérivés déclarée dans le Bilan.

(c) Contrats sur options

Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options à des fins d'optimisation des rendements ou pour couvrir une position existante ou un investissement futur. Un Fonds peut vendre des options d'achat et de vente sur des titres et des instruments financiers dérivés qu'il détient ou dans lesquels il peut investir.

La vente d'options de vente a tendance à accroître l'exposition du Fonds à l'instrument sous-jacent. La vente d'options d'achat a tendance à réduire l'exposition du Fonds à l'instrument sous-jacent. Lorsqu'un Fonds vend une option d'achat ou de vente, un montant égal à la prime reçue est comptabilisé en tant que passif puis évalué à la valeur de marché pour refléter la valeur en cours de l'option vendue. Ces passifs sont compris dans le Bilan. Les primes perçues grâce à la vente d'options qui expirent sont considérées comme des plus-values réalisées. Les primes perçues de la vente d'options exercées ou clôturées sont ajoutées aux produits ou portées en déduction des montants payés sur le contrat à terme standardisé sous-jacent, le swap sous-jacent, le titre sous-jacent ou la transaction sur devises sous-jacente, afin de déterminer la plus-value ou la moins-value réalisée. Certaines options sont parfois vendues avec des primes qui seront déterminées ultérieurement. Les primes de ces options sont basées sur les paramètres de volatilité implicite aux conditions précisées. En tant que vendeur d'une option, un Fonds n'a aucun contrôle sur la vente ou l'achat effectif de l'instrument sous-jacent. Par conséquent, le Fonds assume le risque de marché lié à une évolution défavorable de l'instrument qui sous-tend l'option vendue. Il existe un risque que le Fonds ne puisse conclure une transaction de clôture en raison d'un marché non liquide.

Un Fonds peut également acheter des options de vente et d'achat. L'achat d'options d'achat a tendance à accroître l'exposition du Fonds à l'instrument sous-jacent. L'achat d'options de vente a tendance à réduire l'exposition du Fonds à l'instrument sous-jacent. Le Fonds paie une prime, incluse dans le Bilan en tant qu'actif, et qui est par la suite calculée par référence au marché afin de répercuter la valeur actuelle de l'option. Les primes versées pour l'achat d'options qui expirent sont considérées comme des moins-values réalisées. Certaines options sont parfois achetées avec des primes qui seront déterminées à une date ultérieure. Les primes de ces options sont basées sur les paramètres de volatilité implicite aux conditions précisées. Le risque associé à l'achat d'options d'achat et de vente est limité à la prime versée. Les primes payées pour l'achat d'options exercées ou clôturées sont ajoutées aux montants payés ou portées en déduction des produits réalisés sur l'investissement sous-jacent, afin de déterminer la plus-value ou moins-value réalisée lorsque la transaction sous-jacente est effectuée.

Swaptions de défaillance Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des contrats de swaptions de défaillance pour couvrir l'exposition au risque de crédit d'un investissement sans engagement vis-à-vis de l'instrument sous-jacent. Une swaption de défaillance est une option de vente ou d'achat d'une protection de crédit avec une référence particulière via un contrat de swap prédéfini par une date future précisée.

Options de change Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options de change. La vente et l'achat d'options de change confèrent à un Fonds le droit, mais pas l'obligation, d'acheter ou de vendre les montants spécifiques de devises à un taux de change qui peut être appliqué jusqu'à une certaine date. Ces options peuvent être utilisées comme couverture courte ou longue contre les variations possibles des taux de change ou pour obtenir une exposition à des devises étrangères.

Options plafonnées sur l'inflation Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options plafonnées sur l'inflation à des fins d'optimisation du rendement ou de couverture. Lorsqu'un Fonds vend une option plafonnée sur l'inflation, un montant égal à la prime reçue est comptabilisé en tant que passif puis évalué à la valeur de marché pour refléter la valeur en cours de l'option vendue. Lorsqu'un Fonds achète une option plafonnée sur l'inflation, il verse une prime comptabilisée en tant qu'actif puis évaluée à la valeur de marché pour refléter la valeur en cours de l'option. L'achat d'options plafonnées sur l'inflation vise à protéger le Fonds de l'érosion due à l'inflation au-dessus d'un certain taux sur une exposition notionnelle donnée. Il est possible de recourir à un plancher pour avoir une protection contre la baisse pour des placements dans des produits indexés sur l'inflation.

Options à taux d'intérêt plafonnées Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options à taux d'intérêt plafonnées à des fins d'optimisation du rendement ou de couverture. Lorsqu'un Fonds vend une option à taux d'intérêt plafonnée, un montant égal à la prime reçue est comptabilisé en tant que passif puis évalué à la valeur de marché pour refléter la valeur en cours de l'option vendue. Lorsqu'un Fonds achète une option à taux d'intérêt plafonnée, il verse une prime comptabilisée en tant qu'actif puis évaluée à la valeur de marché pour refléter la valeur en cours de l'option. L'achat d'options à taux d'intérêt plafonnées vise à protéger le Fonds du risque lié aux taux variables au-dessus d'un certain taux sur une exposition notionnelle donnée. Il est possible de recourir à un plancher pour protéger les placements dans des produits indexés sur les taux d'intérêt contre la baisse.

Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse (« Options sur contrat à terme standardisé ») afin de couvrir une position existante ou un investissement futur, à des fins spéculatives ou pour gérer leur exposition aux fluctuations du marché. Une Option sur contrat à terme standardisé est un contrat d'option dans lequel l'instrument sous-jacent est un seul contrat à terme standardisé.

Options sur des contrats à terme standardisés de matières premières Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur des contrats à terme standardisés de matières premières (« Options sur matières premières »). L'instrument sous-jacent de l'Option sur matières premières n'est pas la matière première elle-même mais un contrat à terme standardisé sur cette matière première. L'exercice d'une Option sur matières premières ne comprend pas la livraison physique de la matière première sous-jacente, mais plutôt le règlement direct sur le compte de garde du Fonds de la différence entre la juste valeur en cours du contrat à terme standardisé sous-jacent et le prix d'exercice. S'il s'agit d'une option dans le cours, le Fonds annulera normalement sa position au lieu d'exercer l'option afin de conserver la valeur restante avant la fin.

Options à barrière Certains Fonds peuvent vendre ou acheter une grande variété d'options avec des structures de paiement non conventionnelles ou d'autres caractéristiques (« Options à barrière »). Les Options à barrière sont généralement négociées hors cote. Un Fonds peut investir dans divers types d'Options à barrière notamment des options à barrière activante « down-and-in » et « up-and-in ». Ces options sont similaires à des options standard, mais elles expirent sans aucune valeur pour leur souscripteur si le prix de l'instrument sous-jacent atteint, ou n'atteint pas, un niveau barrière spécifique avant la date d'expiration de l'option.

Swaptions de taux d'intérêt Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des contrats de swaptions de taux d'intérêt, qui sont une option de conclusion d'un contrat de swap prédéfini à une date précise à l'avenir. Le vendeur d'une swaption devient la contrepartie au swap si l'acheteur exerce l'option. Le contrat de swaption de taux d'intérêt précisera si l'acheteur de la swaption sera le receveur ou le payeur d'un taux fixe au moment de l'exercice.

Options sur titres Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur titres afin d'améliorer leur rendement ou de couvrir une position existante ou un investissement futur. Une option sur un titre utilise un titre spécifique comme instrument sous-jacent du contrat d'option.

Options doubles Certains Fonds peuvent souscrire différentes formes d'options doubles (« Option double »). Une Option double est une stratégie qui combine des options qui permettent à un Fonds de bénéficier des futurs mouvements des cours du titre sous-jacent, quelle que soit la direction de ces mouvements. Une Option double vendue implique la vente simultanée d'une option d'achat et d'une option de vente, sur le même titre aux mêmes prix d'exercice et date d'expiration. Une Option double vendue prend de la valeur quand le prix du titre sous-jacent est peu volatil avant la date d'expiration. Une Option double achetée implique l'achat simultané d'une option d'achat et d'une option de vente sur un même titre aux mêmes prix d'exercice et date d'expiration. L'Option double achetée prend de la valeur si le prix du titre sous-jacent est très volatil, quelle que soit la direction de ces mouvements, avant la date d'expiration.

(d) Contrats de swap

Certains Fonds peuvent investir dans des contrats de swap. Les contrats de swaps sont des contrats négociés bilatéralement entre un Fonds et une contrepartie. Ils portent sur l'échange, ou swap, de flux de trésorerie, d'actifs, de devises ou de performances liées au marché à des intervalles futurs précisés. Les contrats de swaps sont des contrats privés négociés sur le marché hors cote (« Swaps hors cote ») ou susceptibles d'être compensés par un tiers, connu sous le nom de contrepartie centrale ou d'organisme de compensation des instruments financiers dérivés (« Swaps compensés »). Un Fonds peut souscrire des contrats de swaps d'actifs, de défaillance, sur devises croisées, de taux d'intérêt, de rendement total, de variance ou autres formes de contrats de swaps, aux fins de gérer son exposition au risque de crédit, de change, de taux d'intérêt, au risque sur matières premières, sur capitaux propres et au risque d'inflation. Dans le cadre de ces contrats, les titres ou espèces peuvent être acceptés en garantie ou à titre de marge conformément aux termes des contrats de swap respectifs afin de donner des actifs de valeur et un moyen de recours en cas de défaillance ou faillite/insolvabilité.

Les swaps compensés sont évalués quotidiennement à la valeur du marché sur la base de valeurs déterminées à partir du contrat sous-jacent ou conformément aux indications de la contrepartie centrale ou de l'organisme de compensation des instruments financiers dérivés. Les variations de la juste valeur, le cas échéant, figurent dans la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente au Compte de résultat.

Les variations quotidiennes de l'évaluation des swaps compensés, le cas échéant, sont comptabilisées au débit ou au crédit, selon la variation (« Marge de variation des swaps »), du Bilan. Les paiements de swap compensés et hors cote reçus ou effectués au début de la période d'évaluation figurent au Bilan et représentent les primes payées ou reçues lors de la conclusion du contrat de swap pour compenser les écarts entre les conditions des contrats de swap et les conditions de marché en vigueur (écarts de crédit, taux de change, taux d'intérêt et autres éléments pertinents). Les primes reçues (payées) d'avance sont initialement comptabilisées au passif (à l'actif) puis évaluées à la valeur du marché afin de refléter la valeur actuelle du swap. Ces primes réglées à l'avance sont comptabilisées comme plus-value ou moins-value réalisée dans le Compte de résultat dès la résiliation ou l'échéance du swap. Un paiement de liquidation reçu ou effectué lors de la résiliation du swap est comptabilisé comme plus-value ou moins-value réalisée dans le Compte de résultat. Les paiements nets périodiques reçus ou effectués par les Fonds sont repris dans les plus-values ou moins-values réalisées du Compte de résultat.

Aux fins d'application de certaines des politiques et restrictions d'investissement du Fonds, les contrats de swap, comme d'autres instruments dérivés, peuvent être évalués par le Fonds à leur juste valeur, à leur valeur notionnelle ou à leur valeur exposée au risque. Dans le cas d'un contrat de swap de défaillance, lors de l'application des politiques et restrictions d'investissement du Fonds, celui-ci évalue le contrat de swap de défaillance à sa valeur notionnelle ou à sa valeur exposée au risque totale (la somme du montant notionnel du contrat plus sa juste valeur), mais peut évaluer le contrat de swap de défaillance à sa juste valeur pour l'application de certaines autres politiques et restrictions d'investissement du Fonds. Par exemple, un Fonds peut évaluer des contrats de swap de défaillance à leur valeur d'exposition au risque totale pour les besoins des lignes directrices du Fonds sur la qualité du crédit (si elles existent), car cette valeur reflète l'exposition économique réelle du Fonds pendant la durée du contrat de swap de défaillance. Dans ce contexte, le montant notionnel et la juste valeur peuvent être positifs ou négatifs selon que le Fonds est acheteur ou vendeur de protection par le biais du contrat de swap de défaillance. La manière dont certains titres ou autres instruments sont évalués par le Fonds pour l'application des politiques et restrictions d'investissement peut différer de la manière dont ces investissements sont évalués par d'autres types d'investisseurs.

La conclusion de tels contrats implique, à différents degrés, des éléments de risques de taux d'intérêt, de crédit, de marché et de documents supérieurs aux montants déclarés dans le Bilan. De tels risques impliquent le risque potentiel d'absence de marché liquide pour ces contrats, le risque que la contrepartie aux contrats manque à son obligation ou soit en désaccord avec la signification des dispositions contractuelles des contrats et le risque que les taux d'intérêt évoluent de manière défavorable.

Pour un Fonds, le risque maximum de perte lié au risque de crédit de la contrepartie est la valeur nette actualisée des flux de trésorerie à recevoir de la contrepartie pour la durée de vie restante du contrat, dans la mesure où le montant est positif. Le risque est limité par un accord général de compensation entre le Fonds et la contrepartie et par une garantie auprès d'un Fonds pour couvrir l'exposition du Fonds à la contrepartie.

Contrats de swap de corrélation Certains Fonds peuvent investir dans des contrats de swap de corrélation pour acquérir ou atténuer leur exposition aux titres de référence sous-jacents. Les contrats de swap de corrélation impliquent que deux parties conviennent d'échanger des flux de trésorerie sur la base de la corrélation évaluée d'un actif sous-jacent précisé. Une partie convient d'échanger un « taux fixe » ou taux d'exercice contre un « taux variable » ou corrélation du prix réalisé de l'actif sous-jacent relatif au montant notionnel. Au moment du lancement, le taux d'exercice est généralement déterminé de telle sorte que la juste valeur du swap soit égale à zéro. À la date d'échéance, un flux de trésorerie net est échangé selon lequel le montant du remboursement est égal à la différence entre la corrélation du prix réalisé de l'actif sous-jacent et le taux d'exercice multiplié par le montant notionnel. En tant que bénéficiaire de la corrélation du prix d'exercice fixé, le Fonds reçoit le montant de remboursement si la corrélation du prix réalisé de l'actif sous-jacent est inférieure au taux d'exercice et verse le montant de remboursement si la corrélation est supérieure au prix d'exercice. En tant que payeur de la corrélation du prix d'exercice fixé, le Fonds doit s'acquitter du montant de remboursement si la corrélation du prix réalisé de l'actif sous-jacent est inférieure au taux d'exercice et reçoit le montant de remboursement si la corrélation est supérieure au prix d'exercice. Ce type de contrat est principalement un contrat à terme sur la corrélation future du prix réalisé de l'actif sous-jacent.

Contrats de swap de défaillance Certains Fonds peuvent utiliser des swaps de défaillance sur émissions privées, des prêts, des émissions souveraines, des obligations municipales américaines ou des bons du Trésor américain afin de disposer d'une mesure de protection contre les défaillances des émetteurs (c'est-à-dire pour réduire le risque lorsque le Fonds détient ou est exposé à l'obligation de référence) ou pour prendre une position longue ou courte active par rapport à la probabilité de défaillance d'un émetteur particulier. Les contrats de swap de défaillance impliquent le versement par une partie (appelée l'« acheteur de protection ») d'une série de paiements à une autre partie (le « vendeur de protection ») en l'échange du droit de recevoir un rendement défini dans le cas d'un événement de crédit de l'entité référencée, de l'obligation ou de l'indice, tel qu'indiqué dans le contrat de swap. En tant que vendeur de protection dans le cadre d'un contrat de swap de défaillance, le Fonds perçoit généralement de l'acheteur de protection un revenu à taux fixe tout au long de la durée du swap à condition qu'aucun événement de crédit ne se produise. En tant que vendeur, un Fonds augmente l'endettement de son portefeuille car, en plus du total de son actif net, il sera exposé au montant notionnel du swap.

Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée, d'autres obligations livrables ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités ou titres équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé. Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée, d'autres obligations livrables ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités ou titres équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé. Les valeurs de recouvrement sont estimées par les teneurs du marché, en tenant compte des taux de recouvrement standard du secteur ou de facteurs et considérations spécifiques à l'entité, jusqu'à ce qu'un événement de crédit se produise. Lorsque survient un événement de crédit, la valeur de recouvrement est déterminée par une enchère dans laquelle on utilise un nombre minimum de demandes de courtiers conjugué à une méthode particulière d'évaluation, pour calculer la valeur du règlement. La possibilité de livrer d'autres obligations peut déclencher l'option de livraison au moindre coût (le droit de l'acheteur de protection à livrer l'obligation dont la valeur est la plus basse après la survenance de l'événement de crédit).

Les contrats de swap de défaillance sur des émissions d'entreprises ou des titres souverains impliquent le versement par une partie d'une série de paiements au bénéfice d'une autre partie en échange du droit de recevoir un rendement défini en cas de défaillance ou d'un autre événement de crédit. Lorsque survient un événement de crédit et qu'un règlement en numéraire n'est pas choisi, il est possible de livrer diverses autres obligations à la place de l'obligation référencée. La possibilité de livrer d'autres obligations peut déclencher l'option de livraison au moindre coût (le droit de l'acheteur de protection à livrer l'obligation dont la valeur est la plus basse après la survenance de l'événement de crédit).

Les contrats de swap de défaillance sur les indices de crédit impliquent le versement par une partie d'une série de paiements au bénéfice d'une autre partie en l'échange du droit de recevoir un rendement défini dans le cas d'une dévaluation, d'une insuffisance de principal, d'une insuffisance d'intérêts ou d'une défaillance de tout ou partie des entités référencées composant l'indice de crédit. Un indice de crédit est un panier d'instruments de ou d'expositions au crédit jugés représentatifs d'une partie du marché du crédit dans son ensemble. Ces indices sont composés de crédits de référence qui sont évalués par un groupe de négociateurs comme étant les entités les plus liquides sur le marché des swaps de défaillance pour le secteur de l'indice. Les composantes des indices peuvent comprendre, notamment, des valeurs mobilières de qualité « investment grade », des valeurs mobilières à rendement élevé, des titres adossés à des actifs, des marchés émergents, et/ou différentes notations de crédit au sein de chaque secteur. Les indices de crédit sont négociés en utilisant des swaps de défaillance avec des conditions normalisées y compris un écart fixe et des dates d'échéance standard. Un swap de défaillance sur indice de crédit référence tous les titres dans l'indice, et en cas de défaillance, les événements de crédit sont réglés en fonction de la pondération de ce nom au sein de l'indice. La composition des indices change de manière périodique, généralement tous les semestres, et pour la plupart des indices, chaque titre possède une pondération équivalente au sein de l'indice. Le Fonds peut utiliser des swaps de défaillance sur des indices de crédit afin de couvrir un portefeuille de swaps de défaillance ou d'obligations moins cher que s'il devait acheter de nombreux swaps de défaillance pour obtenir un effet similaire. Les swaps de défaillance sur des indices de crédit constituent des instruments pour protéger les investisseurs qui détiennent des obligations contre les défaillances et les négociateurs les utilisent pour spéculer sur les variations de la qualité de crédit.

Les écarts de crédit implicites utilisés pour calculer la juste valeur de contrats de swap de défaillance sur émissions d'entreprises, prêts, émissions souveraines, émissions municipales américaines ou du Trésor américain en fin d'exercice le cas échéant, représentés en termes absolus, figurent dans le Tableau des investissements. Ils servent d'indicateur de la situation actuelle du risque de paiement/exécution et représentent la probabilité ou le risque de défaillance de l'entité référencée. L'écart de crédit implicite d'une entité référencée donnée reflète le coût de l'achat/la vente de la protection et peut comprendre des paiements d'avance requis pour pouvoir conclure le contrat. Le creusement d'un écart de crédit signale une détérioration de la qualité de crédit de l'entité référencée et une plus grande probabilité ou un risque accru de défaillance ou d'autres événements de crédit tel que défini dans le contrat. Dans le cas des contrats de swap de défaillance sur titres adossés à des actifs et indices de crédit, les cours de marché cotés et les valeurs qui en résultent constituent l'indicateur de la situation actuelle du risque de paiement/de performance. Une appréciation des justes valeurs, en termes absolus en comparaison du montant notionnel du swap représente une détérioration de la qualité de crédit de l'entité référencée et une plus forte probabilité de défaut ou autre événement de crédit survenant tel que défini dans les termes de l'accord.

Le montant maximum des paiements futurs (sans décotes) qu'un Fonds pourrait être amené à effectuer en tant que vendeur/acheteur de protection au titre d'un contrat de swap de défaillance est un montant égal au montant notionnel du contrat. Les montants notionnels de tous les contrats de swap de défaillance en cours au 31 décembre 2023 dans lesquels le Fonds est vendeur/acheteur de protection figurent dans le Tableau des investissements. La valeur de recouvrement des obligations référencées respectives, les paiements d'avance reçus lors de la conclusion des contrats ou les montants nets reçus du règlement des contrats de swap de défaillance pour l'achat de protection conclus par le Fonds pour la (les) même(s) entité(s) référencée(s) pourraient compenser en partie les montants potentiels à verser.

Accords de swap sur devises croisées Certains Fonds peuvent conclure des accords de swap sur devises croisées pour acquérir ou atténuer leur exposition au risque de change. Les contrats de swap sur devises croisées impliquent l'échange entre deux parties de deux devises différentes assorti d'un accord pour inverser l'échange à une date ultérieure à des taux de change spécifiques. L'échange de devises à la date d'effet du contrat est effectué au taux au comptant en vigueur. Le nouvel échange à l'échéance peut s'effectuer au même taux de change, à un taux déterminé ou au taux au comptant en vigueur. Le cas échéant, les paiements d'intérêts sont effectués entre les parties en fonction des taux d'intérêt disponibles dans les deux devises à la date d'effet du contrat. Les conditions des contrats de swap sur devises croisées peuvent porter sur plusieurs périodes. Les swaps sur devises croisées sont généralement négociés avec les banques commerciales et d'investissement. Certains swaps sur devises croisées peuvent ne pas prévoir d'échange de flux de trésorerie de principal, mais uniquement des échanges de flux de trésorerie d'intérêt. Les opérations de change à la date de lancement seront reflétées séparément sur une base brute avec le montant notionnel du principal en devise au débit ou au crédit, selon le cas pour la partie flottante ou fixe, au Bilan.

En ce qui concerne les catégories couvertes, les plus-values ou moins-values réalisées et latentes sont imputées uniquement aux catégories d'actions correspondantes. Les plus-values ou moins-values latentes figurent dans la rubrique Instruments financiers dérivés du Bilan. Dans le cadre de ces contrats, les titres peuvent être identifiés en tant que garantie conformément aux conditions des contrats respectifs.

Contrats de swap de taux d'intérêt Certains Fonds sont soumis au risque de taux d'intérêt dans le cadre normal de leurs objectifs d'investissements. Pour un Fonds qui détient des obligations à taux fixe, la valeur desdites obligations peut diminuer si le taux d'intérêt augmente. Un Fonds peut conclure des contrats de swap de taux d'intérêt pour se couvrir contre ce risque et conserver sa capacité à générer des revenus aux taux de marché en vigueur. Les contrats de swap de taux d'intérêt impliquent l'échange par le Fonds avec une autre partie de leurs engagements respectifs à payer ou recevoir un intérêt afférent au montant notionnel du principal. Certaines formes de contrats de swap de taux d'intérêt comprennent : (i) les taux plafond, selon lesquels une partie convient, en échange d'une prime, d'effectuer des paiements à l'autre partie dans la mesure où les taux d'intérêt excèdent un taux défini (le « taux plafond »), (ii) les taux plancher, selon lesquels une partie convient, en échange d'une prime, d'effectuer des paiements à l'autre partie dans la mesure où les taux d'intérêt tombent en deçà d'un taux défini (le « taux plancher »), (iii) les tunnels, selon lesquels une partie vend un taux plafond et achète un taux plancher, ou inversement, en vue de se protéger contre les fluctuations des taux d'intérêt excédant des niveaux minimum et maximum déterminés, (iv) les swaps de taux d'intérêt remboursables par anticipation, selon lesquels l'acheteur paie un montant initial en contrepartie du

droit de mettre fin au contrat pour un coût zéro à une date prédéterminée avant la date d'échéance, (v) les swaps à différentiel fixe qui permettent aux utilisateurs de swaps de taux d'intérêt de verrouiller le différentiel (ou écart) futur entre le taux du swap de taux d'intérêt et un indice de référence spécifique, ou (vi) les swaps de base, selon lesquels les deux parties peuvent échanger des taux d'intérêt variables sur la base de différents marchés monétaires.

Contrats de swap de rendement total Certains Fonds peuvent conclure des swaps de rendement total. Les contrats de swap de rendement total sur matières premières impliquent des engagements d'échange de flux de trésorerie basé sur le cours d'une matière première contre un cours ou taux fixe ou flottant. Une partie reçoit des paiements sur la base de la juste valeur de la matière première en question et paie un montant fixe. Les contrats de swap de rendement total sur indices impliquent des engagements à payer des intérêts contre un rendement indexé sur le marché. Une contrepartie paie le rendement total d'un actif de référence particulier, qui peut être une action, un indice ou une obligation, et reçoit en échange une série de paiements réguliers. Si le rendement total du titre ou de l'indice sous-jacent est supérieur ou inférieur à l'obligation de taux d'intérêt de compensation, le Fonds doit recevoir un paiement de la contrepartie ou lui en verser un.

Certains Fonds peuvent investir dans des swaps de rendement total sur actions (« swaps sur actions »). Des swaps sur actions peuvent être utilisés dans le but de générer un profit ou pour éviter une perte relative aux fluctuations de la valeur ou du prix de titres ou d'instruments financiers ou d'un indice sur de tels titres ou instruments financiers. Un swap sur actions est un instrument dérivé conçu pour répliquer le rendement financier et les flux de trésorerie d'un placement en actions conventionnel.

Les risques inhérents dans les swaps sur actions dépendent de la position dans la transaction prise par un Fonds : en utilisant des swaps sur actions, un Fonds peut ouvrir une position longue sur la valeur sous-jacente, auquel cas le Fonds tirera parti de toute augmentation de la valeur de l'action sous-jacente et peut être pénalisé en cas de baisse. Les risques inhérents à une position longue sont identiques à ceux pris lors de l'achat de l'action sous-jacente. À l'inverse, un Fonds peut prendre une position courte sur la valeur de l'action sous-jacente, auquel cas le Fonds va bénéficier de la baisse de l'action sous-jacente et être pénalisé en cas de hausse. Les risques inhérents à une position courte sont plus importants que ceux d'une position longue : alors que la perte maximale sur une position longue est plafonnée si l'action sous-jacente est valorisée à zéro, la perte maximale d'une position courte correspond à celle de la hausse de l'action sous-jacente, une hausse qui est, en théorie, illimitée.

Il convient de noter qu'une position de swap sur actions courte ou longue est fondée sur l'opinion des Conseillers en investissement concernant l'évolution future du prix du titre sous-jacent. La position peut avoir un impact négatif sur la performance du Fonds.

Les contrats de swaps de volatilité sont également appelés contrats de volatilité à terme et swaps de volatilité, et sont des contrats dans lesquels les contreparties conviennent d'effectuer des paiements liés aux variations de la volatilité (c'est-à-dire l'ampleur de la variation sur une période donnée) d'un instrument référencé sous-jacent, tel qu'une devise, un taux, un indice, un titre ou tout autre instrument financier. Les swaps de volatilité permettent aux parties de tenter de couvrir le risque de volatilité et/ou de prendre des positions sur la volatilité future estimée d'un instrument référencé sous-jacent. Par exemple, le Fonds peut conclure un swap de volatilité afin de prendre la position basée sur l'augmentation de la volatilité de l'instrument référencé sur une période donnée. Si la volatilité de l'instrument référencé augmente au cours de la période spécifiée, le Fonds recevra un paiement de sa contrepartie sur la base de la différence entre le niveau de volatilité réalisée de l'instrument concerné et le niveau de volatilité convenu par les parties. Si la volatilité de l'instrument référencé n'augmente pas au cours de la période spécifiée, le Fonds versera un paiement à sa contrepartie sur la base de l'écart entre le niveau de volatilité réalisée de l'instrument concerné et le niveau de volatilité convenu par les parties. À la date d'échéance, un flux de trésorerie net est échangé selon lequel le montant du remboursement est égal à la différence entre la volatilité du prix cours réalisée de l'instrument référencé et le prix d'exercice multiplié par le montant notionnel. En tant que bénéficiaire de la volatilité du prix réalisée, le Fonds reçoit le montant de remboursement si la volatilité des cours réalisée de l'instrument référencé est supérieure au prix d'exercice et verse le montant de remboursement si la volatilité est inférieure au prix d'exercice. En tant que payeur de la volatilité du prix réalisée, le Fonds doit s'acquitter du montant de remboursement si la volatilité du prix réalisée de l'instrument référencé est supérieure au prix d'exercice et reçoit le montant de remboursement si la volatilité est inférieure au prix d'exercice.

Les paiements sur un swap de volatilité seront plus importants s'ils sont basés sur le carré mathématique de la volatilité (c'est-à-dire la volatilité mesurée multipliée par elle-même, appelée « variance »). Ce type de swap de volatilité est souvent appelé swap de variance.

7. GESTION DE PORTEFEUILLE EFFICACE

Dans les limites autorisées par les objectifs et politiques d'investissement des Fonds et sous réserve des limites définies périodiquement par la Banque centrale et les dispositions du Prospectus, le recours, à des fins de gestion de portefeuille efficace, aux instruments financiers dérivés et aux techniques d'investissement est possible pour tous les Fonds. Les Fonds peuvent utiliser ces instruments financiers dérivés et ces techniques d'investissement pour assurer une couverture contre les fluctuations des taux d'intérêt, des taux de change des devises non fonctionnelles ou des cours des titres ou dans le cadre de leur stratégie globale d'investissement.

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Contrats de mise en pension au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023 était de 429 491 320 \$/ (4 038 069 \$) (31 décembre 2022 : 155 496 772 \$/(296 154 \$)).

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Contrats de prise en pension au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023 était de 979 244 \$/ (149 866 376 \$) (31 décembre 2022 : 9 791 008 \$/(45 026 160 \$)).

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Opérations par vente et rachat dos-à-dos au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023 était de 1 074 \$/ (7 634 491 \$) (31 décembre 2022 : 950 \$/(6 496 889 \$)).

8. FISCALITÉ

En vertu des lois et pratiques en vigueur, la Société est admissible en tant que société de placement, conformément à la définition visée à l'article 739B de la loi de consolidation fiscale de 1997 (Taxes Consolidation Act), comme amendée, tant qu'elle est résidente en Irlande. De ce fait, elle n'est pas assujettie à l'impôt irlandais sur les bénéfices ou les plus-values. Toutefois, l'impôt irlandais peut s'appliquer à certains « événements imposables ». Un événement imposable comprend tout paiement de distribution aux actionnaires ou un encaissement, un rachat, une annulation, un transfert ou une cession présumée (une cession présumée survient à l'expiration d'une Période considérée) d'actions ou l'appropriation ou l'annulation d'actions d'un actionnaire par la Société afin de satisfaire le montant d'impôt à payer sur une plus-value résultant d'un transfert.

Le Fonds n'est redevable d'aucun impôt irlandais au titre d'événements imposables au regard de ce qui suit :

(a) un actionnaire qui n'est ni un Résident irlandais, ni un Résident habituel en Irlande à des fins fiscales au moment de l'événement imposable, à condition que le Fonds soit en possession des déclarations valables appropriées conformément aux dispositions de la loi de consolidation fiscale de 1997 (Taxes Consolidation Act), telle qu'amendée, et que le Fonds ne dispose pas d'informations qui pourraient raisonnablement suggérer que les informations contenues dans le présent document ne sont plus substantiellement exactes, ou que le Fonds ait été autorisé par l'administration fiscale irlandaise à effectuer des paiements bruts en l'absence des déclarations appropriées ;

(b) certains actionnaires résidents exonérés de l'impôt irlandais ayant remis au Fonds les déclarations obligatoires requises et signées ;

(c) toute transaction relative à des actions détenues dans un système de compensation reconnu tel que désigné par ordonnance des autorités fiscales ;

(d) un échange d'actions représentant un compartiment contre un autre compartiment du Fonds ;

(e) un échange d'actions découlant d'une fusion ou d'une restructuration admissible du Fonds avec un autre fonds ; et

(f) certains échanges d'actions entre époux et ex-époux.

En l'absence des déclarations appropriées, le Fonds sera assujetti à l'impôt irlandais si un événement imposable se produit.

Le régime des sociétés de placement stipule que les autorités fiscales peuvent agréer les fonds de placement commercialisés hors d'Irlande à faire des paiements à des actionnaires non-résidents sans déduction de l'impôt irlandais si aucune déclaration pertinente n'existe, sous réserve de satisfaire des « mesures équivalentes ». Un Fonds qui veut recevoir l'agrément doit en faire la demande par écrit aux autorités fiscales, en confirmant le respect des conditions pertinentes.

Les dividendes, intérêts et plus-values (le cas échéant) que la Société reçoit relatifs à ses investissements (autres que les titres d'émetteurs irlandais) peuvent être assujettis à des impôts, y compris des retenues à la source, dans les pays dans lesquels les émetteurs des investissements sont situés. Il est prévu que la Société ne puisse bénéficier de taux de prélèvement à la source réduits prévus dans les conventions fiscales visant à prévenir la double imposition entre l'Irlande et de tels pays. Si cette position change à l'avenir et que l'application d'un taux réduit donne lieu à un remboursement à la Société, la Valeur Nette d'Inventaire ne sera pas recalculée et l'avantage sera attribué aux actionnaires existants de façon proportionnelle au moment du remboursement.

Conformément au régime de fonds déclarant introduit par le HM Revenue and Customs du Royaume-Uni, chaque catégorie d'actions sera considérée comme un « fonds offshore » distinct pour les besoins de l'impôt britannique. Le régime de fonds déclarant autorise un fonds offshore à demander un agrément préalable aux autorités fiscales britanniques pour bénéficier du statut de « fonds déclarant ». Lorsqu'un fonds offshore a reçu l'agrément de « fonds déclarant », il maintiendra ce statut tant qu'il continuera à satisfaire les conditions sans avoir à demander une nouvelle certification aux autorités fiscales. Chaque Catégorie d'Actions de la Société est gérée en tant que « fonds déclarant ». Ce traitement a été approuvé par l'administration fiscale britannique (HM Revenue and Customs).

La Directive relative à l'impôt minimum prévoit la mise en œuvre à l'échelle de l'Union européenne des deux règles du Pilier Deux du Cadre inclusif de l'Organisation de coopération et de développement économiques (« OCDE ») sur l'érosion de la base d'imposition et le transfert de bénéfices (« BEPS »). La législation Pilier Deux a été promulguée en Irlande et est en vigueur pour l'exercice commençant le 1^{er} janvier 2024. La Société répond à la définition d'une entité d'investissement en vertu des règles du Pilier Deux du BEPS et de la clause qui y est intégrée visant à protéger la neutralité fiscale des fonds d'investissement. Cela exclut la Société des informations quantitatives requises au titre du Pilier Deux du BEPS, ainsi que de l'exigence relative à l'impôt complémentaire minimum qualifié prélevé localement (« ICMQL »).

9. POLITIQUE DE DISTRIBUTION DE DIVIDENDES

Comme stipulé dans le Supplément du Fonds correspondant, la distribution des dividendes peut être déclarée sur :

- (i) le produit net des investissements consistant en intérêts et dividendes ;
- (ii) les gains réalisés sur la liquidation d'investissements moins les pertes réalisées et latentes (incluant frais et dépenses). Si les bénéfices réalisés lors de la cession d'investissements minorés des pertes réalisées et latentes sont négatifs, les Fonds peuvent toutefois verser des dividendes à partir du revenu net des investissements et/ou du capital.
- (iii) d'autres fonds (capital compris) susceptibles d'être légalement distribués à partir du Fonds ou de la Catégorie d'actions du Fonds concerné.

Les Frais de gestion et autres, ou une partie de ceux-ci, peuvent être imputés au capital et, de ce fait, celui-ci peut s'éroder et les distributions seront réalisées en renonçant à la croissance potentielle future du capital. Ce cycle peut se poursuivre jusqu'à épuisement total du capital. Le raisonnement qui préside à l'imputation au capital consiste à maximiser le montant distribuable aux actionnaires.

Dans le cas de la catégorie d'actions de distribution II, les Administrateurs peuvent, à leur gré, payer les commissions à partir du capital et prendre en considération l'écart de rendement entre la Catégorie d'Actions couverte pertinente et la Catégorie d'Actions de base (qui constitue une distribution à partir du capital). L'écart de rendement peut être positif ou négatif et est calculé en prenant en compte la contribution de la couverture de la Catégorie d'Actions découlant des Catégories couvertes.

Dans le cas des Catégories M Détail, les Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Asia Strategic Interest Bond Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Short-Term Fund, Income Fund, Low Duration Income Fund, Mortgage Opportunities Fund et US Short-Term Fund, à l'exception des Catégories G Institutions, G Détail, E de distribution Q, E de distribution II Q et Investisseurs de distribution A (le cas échéant) des Fonds susmentionnés, les distributions de dividendes sont déclarées tous les mois et, au gré de l'actionnaire, payées en espèces ou réinvesties dans d'autres actions chaque mois.

Dans le cas des catégories Administrations du Fonds Diversified Income Fund, des Catégories d'Actions BE Détail, BM Détail, BN Détail, M Détail et N Détail, les distributions de dividendes sont déclarées chaque mois et ces dividendes sont, au gré de l'Actionnaire, payés en espèces ou réinvestis dans d'autres actions chaque mois.

Dans le cas des Catégories G Institutions, G Détail et Investisseurs de distribution A, les distributions de dividendes sont déclarées tous les ans et ces dividendes sont, au gré de l'actionnaire, payés en espèces ou réinvestis dans d'autres actions chaque année.

Pour tous les autres Fonds ayant des Catégories d'Actions de distribution, les dividendes seront déclarés trimestriellement et, au gré de l'actionnaire, payés en espèces ou réinvestis en actions supplémentaires après déclaration.

Dans le cas des Catégories de décumulation BM Détail et de décumulation M Détail, les Administrateurs peuvent, à leur discrétion, verser des distributions et des commissions à partir du capital. Les Frais de gestion et les autres frais éventuels, ou une partie de ceux-ci, peuvent être prélevés sur le capital des Catégories de décumulation BM Détail et de décumulation M Détail. Par conséquent, le capital est susceptible de s'éroder et le revenu peut être généré en renonçant au potentiel de croissance future du capital.

La distribution de dividendes aux porteurs de parts rachetables figure au poste Frais financiers du Compte de résultat. Le revenu ou les plus-values affecté(es) aux Actions de capitalisation ne sont ni déclaré(es), ni distribué(es), mais la Valeur Nette d'Inventaire par action des Actions de capitalisation est augmentée en fonction de ce revenu ou de ces plus-values. Les distributions de dividendes non réinvestis dans des actions sont versées aux actionnaires par virement bancaire. Toute distribution de dividende non réclamée à l'issue d'un délai de six ans à compter de la date de déclaration de ladite distribution est perdue par défaut et reversée sur le compte du Fonds concerné. Les Actionnaires peuvent choisir de réinvestir leurs distributions de dividendes dans d'autres Actions ou de percevoir leurs distributions de dividendes en espèces en cochant la case correspondante sur le Formulaire de demande. Une partie des distributions de dividendes figurant dans le Compte de résultat a été payée sur le capital des Fonds ci-dessous (montants en milliers) :

| Fonds | Exercice clos le 31 décembre 2023 | Exercice clos le 31 décembre 2022 |
|--|--------------------------------------|--------------------------------------|
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | \$ 1 571 | \$ 2 887 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | 311 | 30 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | 94 | 1 |
| Fonds Diversified Income Fund | 2 113 | 5 609 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | 1 240 | 524 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | 811 | 237 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | € 434 | € 4 339 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | \$ 2 | \$ 0 |
| Fonds Global Bond Fund | 549 | 824 |
| Fonds Global Bond ESG Fund | 209 | 0 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 501 | 124 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 1 892 | 0 |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | 461 | 0 |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 1 172 | 131 |
| Fonds Global Real Return Fund | 5 083 | 805 |
| Fonds Income Fund | 9 861 | 3 564 |
| Fonds Low Average Duration Fund | 15 | 19 |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 13 | 0 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 1 716 | 644 |
| Fonds Strategic Income Fund | 1 | 0 |
| Fonds Total Return Bond Fund | 0 | 104 |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | £ 363 | £ 247 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | 9 | 69 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | 1 | 0 |

10. RÉTROCESSION DE COMMISSIONS

La Société ou son Conseiller en investissement peut effectuer des opérations pour le compte des Fonds avec ou par le biais de l'agence de courtiers exécutifs, qui peut, outre l'exécution d'ordres ordinaires, de temps à autre, fournir ou veiller à ce que soient fournis à la Société ou ses représentants des biens, services ou autres bénéfices tels que des services de recherche et conseils. La Société ou son Conseiller en investissement peuvent payer à ces courtiers des commissions de courtage dont une partie peut être affectée à la fourniture de biens ou services autorisés. Ces Conseillers en investissement qui sont des sociétés d'investissement dans le cadre de la Directive concernant les marchés d'instruments financiers (« MiFID »), ou qui sont soumis à des directives similaires, paieront sur leurs propres ressources pour toute recherche effectuée par des tiers qu'ils ont commanditée en relation avec la gestion des actifs de chaque Fonds.

11. RESPONSABILITÉ SÉPARÉE

La Société est une société d'investissement à capital variable à compartiments multiples et responsabilité séparée entre les compartiments. En conséquence, tout passif au nom d'un Fonds de la Société ou qui lui est attribuable doit être acquitté uniquement sur les actifs de ce Fonds, et ni la Société ni ses Administrateurs, ses administrateurs judiciaires, auditeurs, liquidateurs,

liquidateurs provisoires ni toute autre personne ne doivent appliquer, ou être obligés d'appliquer, les actifs dudit Fonds afin de s'acquitter d'un passif encouru au nom d'un autre Fonds de la Société ou qui lui est attribuable, indépendamment de la date à laquelle ledit passif a été encouru.

12. MODIFICATIONS DU PROSPECTUS, DU SUPPLÉMENT, DE L'ACTE CONSTITUTIF ET DES STATUTS

Le 3 janvier 2023, les Suppléments des Fonds Income Fund II et Low Duration Income Fund ont été mis à jour afin de modifier les abandons de Frais de gestion. À la même date, les Suppléments des Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund, PIMCO Capital Securities Fund, Dynamic Multi Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, UK Corporate Bond Fund, UK Long Term Corporate Bond Fund ont été mis à jour pour modifier les Jours de négociation.

Le 18 janvier 2023, les Suppléments des Fonds Euro Short-Term Fund et PIMCO European Short-Term Opportunities Fund ont été mis à jour afin de modifier les abandons de Frais de gestion.

Le 19 avril 2023, les Suppléments des Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund, Inflation Multi-Asset Fund et PIMCO Balanced Income and Growth Fund ont été mis à jour afin de modifier la politique d'investissement pour prévoir que les Fonds puissent investir jusqu'à 20 % de leurs actifs nets dans des billets structurés, tel que décrit plus en détail dans les Suppléments. Les billets structurés ne modifieront pas sensiblement la politique d'investissement et seront utilisés pour obtenir une exposition aux secteurs déjà visés dans la politique d'investissement.

Le 16 mai 2023, le Supplément du Fonds StocksPLUS™ Fund a été mis à jour afin de supprimer la directive d'investissement qui stipule que le Fonds doit détenir au moins 50 % de titres à revenu fixe avec règlement le jour même. À la même date, le Supplément du Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund a été mis à jour afin de préciser que tous les secteurs de l'énergie ne font pas partie de l'univers d'exposition aux matières premières du Fonds.

Le 2 juin 2023, le Supplément du Fonds PIMCO Climate Bond Fund a été mis à jour afin de modifier les abandons de Frais de gestion.

Le 30 juin 2023, le Supplément du Fonds Euro Credit Fund a été mis à jour afin de modifier les abandons de Frais de gestion.

Le 1^{er} septembre 2023, le Supplément du Fonds Euro Short-Term Fund a été mis à jour afin de modifier l'indice de référence utilisé par le Fonds.

Le 11 septembre 2023, les Suppléments des Fonds Diversified Income ESG Fund, Emerging Local Bond ESG Fund, Emerging Markets Bond ESG Fund, PIMCO ESG Income Fund, Global Bond ESG Fund, Global Investment Grade Credit ESG Fund et Low Duration Opportunities ESG Fund ont été mis à jour pour modifier la politique d'investissement. La politique d'investissement a été mise à jour pour indiquer que les Fonds peuvent investir dans des produits dérivés sur indice, tels que des swaps de défaillance, qui peuvent fournir une exposition indirecte aux émetteurs exclus, mise à jour pour modifier la stratégie d'exclusion des Fonds conformément à la politique d'exclusion de PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (PGAIL) en matière de durabilité, qui a été mise à disposition sur le site Web de PGAIL et mise à jour pour clarifier les informations existantes relatives à l'engagement des émetteurs.

Le 29 septembre 2023, les Suppléments des Fonds Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, PIMCO Capital Securities Fund, Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Short-Term Fund, Global Real Return Fund, Global Low Duration Real Return Fund ont été mis à jour pour promouvoir les caractéristiques sociales en élargissant la liste d'exclusion du Fonds afin d'ajouter les secteurs des armes militaires et du tabac ; et clarifier davantage les informations existantes relatives à l'engagement des émetteurs.

À la même date, le Supplément du Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund a été mis à jour pour indiquer explicitement que le Fonds promouvra les caractéristiques environnementales et sociales en appliquant des critères ESG contraignants à la sélection des actifs sous-jacents qui cohabitent avec les stratégies d'investissement actuelles des Fonds. Le Supplément du Fonds a été mis à jour pour inclure une Annexe précontractuelle comme l'exige le Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Le 29 novembre 2023, le Supplément du Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund a été mis à jour pour renommer le Fonds « PIMCO Balanced Income and Growth Fund » après approbation réglementaire. Outre le changement de nom et comme notifié aux actionnaires, le Supplément a été mis à jour pour refléter certaines modifications non significatives apportées à la politique d'investissement.

À la même date, les Suppléments des Fonds Diversified Income Fund, Emerging Markets Bond Fund et Global Investment Grade Credit Fund ont été mis à jour pour créer un nouveau type de catégorie d'actions, à savoir la catégorie d'actions « Decumulation ». Les catégories d'actions « Decumulation » comprennent la Catégorie M Retail Decumulation et la Catégorie BM Retail Decumulation. En outre, la Catégorie BM Retail a également été ajoutée au Supplément du Fonds Global Investment Grade Credit Fund.

L'Acte constitutif et les Statuts de la Société ont été modifiés le 13 septembre 2023 afin de fournir la flexibilité en vertu des Statuts pour établir (i) des Catégories d'Actions de participation ETF ; qui sont des Actions de participation négociées toute la journée sur au moins un marché réglementé ou une plateforme de négociation multilatérale et (ii) des Catégories d'Actions de participation non-ETF ; qui sont des Action de participation qui ne sont pas négociées toute la journée.

13. COMMISSIONS ET FRAIS

(a) Commissions payables au Gestionnaire

À l'exception des Actions BN Détail, BM Détail et BE Détail tel qu'indiqué dans le Supplément du Fonds concerné, la Commission unifiée ne dépassera pas 2,50 % par an de la VNI de chaque Fonds.

(b) Frais de gestion

Le Gestionnaire, pour chaque Fonds et comme décrit dans le Prospectus, fournit des services de conseil en investissement, d'administration, de dépositaire et autres, en contrepartie desquels chaque Fonds lui verse des Frais de gestion uniques. Les Frais de gestion de chaque Fonds (telle que définie dans le Prospectus) sont cumulés lors de chaque Jour de négociation (tel que défini dans le Supplément du Fonds pertinent) et payables mensuellement à terme échu. Le Gestionnaire peut verser les Frais de gestion en totalité ou en partie aux Conseillers en investissement afin de rémunérer les services de conseil en investissement et autres fournis par les Conseillers en investissement et afin que ces derniers rémunèrent les services d'administration, de dépositaire et autres des Fonds fournis par le Gestionnaire.

Les Frais de gestion de chaque catégorie de chaque Fonds (exprimés en pourcentage annuel de sa VNI) sont les suivants :

| | Catégories Institutions, G Investisseurs, Administrations (%) | Catégorie H Institutions (%) | BE Détail BM Détail BN Détail Catégories E, G Détail, M Détail, N Détail, T (%) | Catégorie R (%) | Catégorie W (%) |
|--|---|------------------------------|--|-----------------|-----------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | 0,65 | 0,82 | 1,55 | S/O | S/O |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 0,65 | S/O | 1,50 | S/O | S/O |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund ⁽¹⁾ | 0,95 | 1,12 | 2,15 | S/O | S/O |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | 0,79 | S/O | 1,69 | 0,93 | S/O |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | 0,52 | S/O | 1,42 | S/O | S/O |
| Fonds Commodity Real Return Fund | 0,74 | 0,91 | 1,64 | S/O | S/O |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 0,90 | S/O | 1,80 | S/O | S/O |
| Fonds Diversified Income Fund | 0,69 | 0,86 | 1,59 | S/O | 0,55 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | 0,69 | S/O | 1,59 | S/O | S/O |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | 0,72 | S/O | 1,62 | S/O | S/O |
| Fonds Dynamic Bond Fund | 0,90 | 1,07 | 1,80 | 0,99 | S/O |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | 0,85 | 1,02 | 1,85 | S/O | S/O |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | 0,89 | 1,06 | 1,89 | S/O | S/O |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | 0,92 | S/O | 1,92 | S/O | S/O |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 0,79 | 0,96 | 1,69 | S/O | S/O |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | 0,89 | S/O | 1,74 | S/O | S/O |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | 0,95 | S/O | 1,85 | S/O | S/O |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund ⁽²⁾ | 0,80 | S/O | 1,70 | S/O | S/O |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 0,85 | S/O | 1,75 | S/O | S/O |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | 0,59 | S/O | 1,49 | 0,82 | S/O |
| Fonds Euro Bond Fund | 0,46 | S/O | 1,36 | S/O | S/O |
| Fonds Euro Credit Fund ⁽³⁾ | 0,46 | 0,38 | 1,36 | S/O | S/O |
| Fonds Euro Income Bond Fund | 0,49 | S/O | 1,39 | S/O | S/O |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | 0,46 | S/O | 1,36 | S/O | S/O |
| Fonds Euro Short-Term Fund ⁽⁴⁾ | 0,29 | S/O | 1,04 | S/O | S/O |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | 0,55 | S/O | 1,45 | S/O | S/O |

| | Catégories Institutions, G Investisseurs, Administrations (%) | Catégorie H Institutions (%) | BE Détail BM Détail BN Détail Catégories E, G Détail, M Détail, N Détail, T (%) | Catégorie R (%) | Catégorie W (%) |
|---|---|------------------------------|--|-----------------|-----------------|
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund ⁽⁵⁾ | 0,32 | 0,49 | 0,82 | S/O | S/O |
| Fonds Global Advantage Fund | 0,70 | S/O | 1,70 | S/O | S/O |
| Fonds Global Bond Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 | 0,39 |
| Fonds Global Bond ESG Fund | 0,52 | S/O | 1,42 | S/O | S/O |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | S/O | S/O |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 | S/O |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 | 0,39 |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | 0,52 | S/O | 1,42 | S/O | S/O |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 0,49 | S/O | 1,39 | S/O | S/O |
| Fonds Global Real Return Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 | S/O |
| Fonds Income Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 | S/O |
| Fonds Income Fund II | 0,59 | S/O | 1,49 | S/O | S/O |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | 0,79 | 0,96 | 1,69 | S/O | S/O |
| Fonds Low Average Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 | S/O |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 0,49 | S/O | 1,39 | S/O | S/O |
| Fonds Low Duration Income Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | S/O | S/O |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 0,49 | S/O | 1,20 | S/O | S/O |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | 0,52 | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 0,99 | S/O | 1,89 | S/O | S/O |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | 0,69 | 0,86 | 1,59 | S/O | S/O |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | S/O | S/O |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 0,69 | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Fonds Strategic Income Fund | 0,79 | S/O | 1,69 | S/O | S/O |
| Fonds Total Return Bond Fund | 0,50 | 0,67 | 1,40 | 0,77 | S/O |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 1,40 | 1,57 | 2,50 | S/O | S/O |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | 0,46 | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | 0,46 | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Fonds US High Yield Bond Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 | S/O |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | S/O | S/O |
| Fonds US Short-Term Fund ⁽⁶⁾ | 0,45 | 0,62 | 0,85 | S/O | S/O |

- (1) Le montant ci-dessus pour le taux de la Catégorie M Retail ne tient pas compte d'un abandon de frais par le Gestionnaire au taux de 0,55 %, ce qui réduit la commission de gestion de la Catégorie M Retail à 1,60 % jusqu'au 28 novembre 2028. Le montant ci-dessus pour le taux de la Catégorie BM Retail ne tient pas compte d'un abandon de frais par le Gestionnaire au taux de 0,55 %, ce qui réduit la commission de gestion de la Catégorie BM Retail à 2,60 % jusqu'au 28 novembre 2028. Ces abandons de frais expireront à compter du 29 novembre 2028.
- (2) Ce chiffre prend en compte un abandon de frais par le Gestionnaire au taux de 0,05 % pour la Catégorie Investisseurs du 31 mai 2021 au 31 mai 2023. Cet abandon de frais a expiré le 1er juin 2023.
- (3) Pour toutes les Catégories, le chiffre prend en compte un abandon de frais par le Gestionnaire au taux de 0,15 % par an. L'abandon de frais était de 0,30 % par an avant le 1er juin 2023. L'abandon de frais prendra fin le 1er juin 2024 et pourrait rester en vigueur jusqu'à ce que le Gestionnaire, sur préavis écrit aux actionnaires du Fonds, décide de mettre fin ou de cesser d'appliquer ces frais ou d'en réduire la portée pour toute période ultérieure.
- (4) Le taux de la Catégorie H Institutions prend en compte un abandon de frais par le Gestionnaire au taux de 0,25 % par an à compter du 30 juin 2023. Cet abandon de frais expirera le 1er juillet 2024.
- (5) Les taux de la Catégorie Institutions et de la Catégorie E prennent en compte un abandon de frais par le Gestionnaire à un taux de 0,11 % par an à partir du 31 mai 2021. Cet abandon de frais expirera à compter du 19 janvier 2025.
- (6) Les taux des Catégories Institutions et H Institutions prennent en compte un abandon de frais par le Gestionnaire de 0,14 % par an. Le taux de la Catégorie E tient compte d'un abandon de frais par le Gestionnaire au taux de 0,54 % par an. L'abandon de frais expirera à compter du 18 janvier 2025.
- (7) Les taux indiqués pour les Catégories E, G Détail et M Détail tiennent compte de l'abandon de frais par le Gestionnaire au taux de 0,30 % par an. Les abandons de frais resteront en vigueur au moins jusqu'à ce que le Gestionnaire, sur préavis écrit aux actionnaires du Fonds, décide de mettre fin ou de cesser d'appliquer cet abandon de frais ou d'en réduire la portée pour toute période ultérieure.

Les Frais de gestion pour tous les Fonds sont restés inchangés depuis le 31 décembre 2022 à l'exception des modifications d'abandon de frais mentionnées ci-dessus.

Les Frais de gestion imputables aux Catégories H Institutions, BE Détail, BM Détail, BN Détail, E, G Détail, M Détail, N Détail et T sont généralement supérieurs à ceux imputables aux autres catégories d'actions. À partir de cette commission majorée, le Gestionnaire peut payer les dépenses occasionnées par la distribution, les intermédiaires et autres services rendus aux actionnaires pour ces catégories d'actions des Fonds, directement ou indirectement, par des distributeurs, courtiers-négociants, banques, intermédiaires financiers ou autres. Compte tenu du caractère fixe des Frais de gestion, le Gestionnaire, et non les Actionnaires, assume le risque que les charges de ces services dépassent les Frais de gestion en conséquence d'une diminution des actifs nets. À l'inverse, le Gestionnaire, et non les actionnaires, profitera de la baisse du prix des services couverts par lesdits Frais de gestion. Il profitera également de la baisse des niveaux de frais afférents à ces services, en pourcentages des actifs nets, du fait de la hausse des actifs nets.

En raison de la nature spécifique des Actions de Catégorie Z, le Compte de résultat ne comporte pas de Frais de gestion (la Catégorie Z est essentiellement offerte aux autres Fonds de la Société ou à des fins d'investissement direct par des investisseurs institutionnels qui ont conclu un accord de gestion ou tout autre contrat avec les Conseillers en investissement ou toute autre société affiliée de PIMCO) et, afin d'éviter la duplication des frais, les Frais de gestion de la Catégorie Z sont fixés à 0,00 % par an.

(c) Services de conseil en investissement

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la prestation de services de conseil en investissement pour le compte de la Société. Ces services couvrent l'investissement et le réinvestissement des actifs de chacun des Fonds. Les commissions des Conseillers en investissement (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payées par le Gestionnaire sur les Frais de gestion.

(d) Services d'administration, de dépositaire et autres services

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la fourniture de services d'administration, de dépositaire et autres pour le compte de la Société. Lesdits services incluent des services d'administration, d'agent de transfert, de comptabilité des fonds, de dépositaire et de sous-dépositaire de chaque Fonds. Les commissions et frais de l'Agent administratif et du Dépositaire (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payés par le Gestionnaire sur les Frais de gestion ou par les Conseillers en investissement.

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la fourniture d'autres services pour le compte de la Société. Parmi ces services figurent les services de cotation par un courtier, d'agent payeur et d'autres services de représentant local, de comptabilité, d'audit, des services juridiques et d'autres services de conseil professionnel, des services de secrétariat de la Société, d'impression, de publication et de traduction, et la fourniture et la coordination de certains services de supervision, d'administration et services aux actionnaires nécessaires au fonctionnement des Fonds. Les commissions et frais ordinaires afférents à ces services (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payés par le Gestionnaire, ou les Conseillers en investissement pour le compte du Gestionnaire, sur les Frais de gestion.

Les Fonds supporteront d'autres frais liés à leur fonctionnement qui ne sont pas couverts par les Frais de gestion et qui peuvent varier et influencer sur le niveau total de frais des Fonds dont, sans y être limité, les impôts et taxes gouvernementales, les frais de courtage, les commissions et autres frais de transaction (y compris, mais sans s'y limiter, les frais et dépenses liés à la vérification préalable des investissements et des investissements potentiels et/ou aux négociations de ces transactions), les coûts d'emprunt d'argent, dont les frais d'intérêts, les frais d'établissement, les dépenses exceptionnelles (comme les frais de litiges et les indemnités) et les jetons de présence et frais des Administrateurs indépendants de la Société et de leur conseiller.

La Société a acquitté des honoraires aux Administrateurs indépendants à hauteur de 180 000 € pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 (31 décembre 2022 : 180 000 €). De plus, chaque Administrateur indépendant est remboursé de ses débours raisonnables. Les Administrateurs non indépendants ne sont pas habilités à séparer les rémunérations pour leur mandat d'administrateur de la Société. Les honoraires des Administrateurs sont comptabilisés en « Autres charges » dans le Compte de résultat.

Le tableau ci-après présente les frais que la Société a été facturée par les commissaires aux comptes pendant les exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022. Les frais figurant dans le tableau ci-dessous sont indiqués hors TVA.

| Honoraires des Commissaires aux comptes | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
|---|------------------|------------------|
| Audit des états financiers de l'entité | € 661 598 | € 636 152 |
| Autres services d'assurance | 0 | 0 |
| Services de conseils fiscaux | 0 | 0 |
| Autres services non liés à l'audit | 0 | 0 |

Frais de service Les Frais de services, qui s'appliquent aux Catégories Investisseurs, sont payés uniquement au Gestionnaire et peuvent servir à rembourser les courtiers-négociants, les intermédiaires financiers ou autres intermédiaires fournissant des services afférents à la distribution et à la commercialisation d'Actions et/ou à la prestation de certains services aux actionnaires ou à l'administration de plans ou de programmes pour lesquels les Actions des Fonds sont des sources de financement, et à rembourser d'autres frais liés (tels que définis dans le Supplément du Fonds concerné). Ces services sont fournis directement par le Gestionnaire ou indirectement par des courtiers-négociants, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les Actionnaires des Catégories Investisseurs. Les mêmes services s'appliquent à tous les actionnaires des Catégories Investisseurs qui supportent les frais. Ces services peuvent inclure : répondre aux questions des actionnaires concernant les Fonds et leur performance, aider les actionnaires pour l'achat, le rachat et l'échange d'Actions ; maintenir des informations sur les comptes personnels et fournir des relevés de comptes aux actionnaires ; et conserver d'autres archives importantes pour l'investissement d'un actionnaire dans les Fonds.

Les plans ou programmes qui utilisent des Actions de Fonds comme source de financement peuvent inclure des produits d'assurance à capital variable et des régimes de pension, de retraite ou d'épargne gérés par les employeurs. Tous les actionnaires des Catégories Investisseurs bénéficient de ces services en vertu de contrats conclus avec les intermédiaires financiers qui entretiennent avec ces actionnaires des relations de prestataires de services. Les Frais de service sont calculés sur la base de 0,35 % par an de la VNI de chaque Fonds imputable aux Catégories Investisseurs. Le taux des Frais de service n'a pas changé au cours des exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022. Ils sont payés sur la VNI imputable aux Catégories Investisseurs de la VNI de ces Fonds. Les Frais de services pour chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont exigibles chaque mois à terme échu. Le Gestionnaire peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de service qui ne sont pas dus aux courtiers-négociants, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

Frais de commercialisation Les Frais de commercialisation, qui s'appliquent aux Catégories Administrations, sont payés au Distributeur au titre des services personnels qu'il rend aux actionnaires des Fonds et de la tenue des comptes des actionnaires. Cela comprend les rémunérations et les frais afférents (frais téléphoniques et frais généraux compris) dus aux consultants financiers ou autres salariés de courtiers partenaires ou remisiers, à certaines banques et à d'autres intermédiaires financiers qui participent au traitement des demandes d'achat ou de rachat ou au traitement des versements de dividendes, qui fournissent des informations régulières aux actionnaires montrant leurs positions dans les Actions d'un Fonds, qui communiquent les informations de la Société aux actionnaires, qui donnent des conseils réguliers sur la pertinence d'investissements spécifiques proposés par les Fonds en fonction des besoins des actionnaires, qui répondent aux demandes de renseignement des actionnaires sur ces services ou qui forment du personnel pour la prestation de ces services.

Ces services sont fournis directement par le Distributeur ou indirectement par des courtiers-négociants, des banques, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les actionnaires des Catégories Administrations. Les Frais de commercialisation sont calculés sur une base de 0,50 % par an de la VNI de chaque Fonds, à l'exception du Fonds StocksPLUS™ Fund pour lequel ils sont calculés sur une base de 0,75 % par an, attribuable aux Catégories Administrations. Les Frais de commercialisation de chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont payables chaque mois à terme échu. Le Distributeur peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de commercialisation qui ne sont pas à verser aux courtiers-négociants, aux banques, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

Le taux des Frais de commercialisation n'a pas changé au cours des exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

(e) Frais de distribution

Les Frais de distribution qui s'appliquent aux Actions de Catégories T, BN Détail, BM Détail et BE Détail sont versés au Distributeur au titre de services rendus aux actionnaires des Fonds.

Ces services sont fournis directement par le Distributeur ou indirectement par des courtiers-négociants, des banques, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les actionnaires de la Catégorie T. Les Frais de distribution sont calculés sur la base de 0,40 % par an de la VNI de chaque Fonds imputable à la Catégorie d'Actions T, à l'exception des Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Dynamic Bond Fund, Euro Bond Fund, Global Bond Fund, Global Bond ESG Fund, Global Bond Ex-US Fund, Global Low Duration Real Return Fund, Global Real Return Fund, Low Duration Opportunities Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund et Total Return Bond Fund qui supportent des Frais de distribution de 0,30 % par an de la VNI de ces Fonds imputables à la Catégorie d'Actions T.

Concernant les Catégories d'Actions BE Détail, BM Détail et BN Détail uniquement, lorsque c'est indiqué dans le Supplément concerné, les Frais de distribution peuvent atteindre 1 % de la VNI et par conséquent la Commission unifiée peut dépasser 2,50 % de la VNI.

Les Frais de distribution pour chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont exigibles chaque mois à terme échu. Le Distributeur peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de distribution qui ne sont pas à verser aux courtiers-négociants, aux banques, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

(f) Limitation des dépenses (incluant la Renonciation et la Récupération des Frais de gestion)

Le Gestionnaire a convenu avec la Société, conformément au Contrat de gestion conclu entre la Société et le Gestionnaire le 28 janvier 1998, tel que modifié, de gérer le total annuel des charges d'exploitation de toute Catégorie d'un Fonds, en renonçant à, réduisant ou remboursant tout ou partie de ses Frais de gestion, dans la mesure où (et pour une durée où) ces charges d'exploitation seraient supérieures, en raison du paiement de frais de constitution et de la part proportionnelle des jetons de présence des Administrateurs, à la somme des Frais de gestion de cette Catégorie de ce Fonds (avant application de l'abandon des Frais de gestion applicable), des Frais de services ou de commercialisation, le cas échéant, et autres frais supportés par cette Catégorie d'actions du Fonds non couverts par les Frais de gestion tel que décrit ci-dessus (autres que les frais de constitution et la part proportionnelle des jetons de présence des Administrateurs) plus 0,0049 % par an (calculés quotidiennement sur la VNI du Fonds).

Au cours d'un mois où le Contrat de gestion est en vigueur, le Gestionnaire peut récupérer sur un Fonds toute partie des Frais de gestion abandonnés, réduits ou remboursés conformément au Contrat de gestion (le « Montant de remboursement ») au cours des 36 mois précédents, sous réserve que ce montant payé au Gestionnaire 1) n'excèdera pas 0,0049 % par an des actifs nets moyens de la Catégorie du Fonds (calculés quotidiennement) ; 2) n'excèdera pas le Montant de remboursement total ; 3) ne comportera aucun montant déjà remboursé au Gestionnaire ; ou 4) n'aura pas pour effet de maintenir une Catégorie d'un Fonds à un rendement négatif net.

Les Frais de gestion qui figurent dans le Compte de résultat sont enregistrés bruts de l'abandon des Frais de gestion concernés le cas échéant. Les abandons de Frais de gestion sont enregistrés à la rubrique Remboursement par les Conseillers en investissement du Compte de résultat. Les Frais de gestion sont versés au Gestionnaire nets de l'abandon.

14. TRANSACTIONS AVEC DES PARTIES LIÉES

Le Gestionnaire, les Conseillers en investissement, les Distributeurs et les Administrateurs sont des parties liées de la Société. Les honoraires dus à ces parties sont détaillés dans la Note 13, le cas échéant.

Au 31 décembre 2023, le Gestionnaire détenait 1 193 662 (31 décembre 2022 : 1 786 291) actions du Fonds US Short-Term Fund.

Chacun des Fonds peut investir dans les autres Fonds de la Société et/ou d'autres organismes de placement collectif gérés par le Gestionnaire ou des entités affiliées au Gestionnaire (« Fonds affilié »).

Les Fonds suivants détenaient des investissements croisés pendant les exercices clos le 31 décembre 2023 et 31 décembre 2022. Ces investissements ont été éliminés aux fins de présentation du total des Fonds de la Société.

| Fonds | 31 décembre 2023 |
|---|--|
| | Investissements croisés |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Fonds PIMCO Capital Securities Fund |
| Fonds Diversified Income Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Fonds Diversified Income Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Fonds Diversified Income Fund | Fonds US Short-Term Fund |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Fonds US Short-Term Fund |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Fonds US Short-Term Fund |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Fonds PIMCO Capital Securities Fund |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Fonds Income Fund |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Euro Income Bond Fund | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds Global Bond Ex-US Fund |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds UK Corporate Bond Fund |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds US Short-Term Fund |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Fonds Low Average Duration Fund | Fonds US Short-Term Fund |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Fonds Total Return Bond Fund | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Fonds Total Return Bond Fund | Fonds US Short-Term Fund |
| Fonds US High Yield Bond Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Fonds US High Yield Bond Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund |

| Fonds | 31 décembre 2022 | | 31 décembre 2023 | |
|---|--|--|------------------|------------|
| | Investissements croisés | | Achats | Ventes |
| Fonds Diversified Income Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | \$ 822 170 | \$ 893 204 |
| Fonds Diversified Income Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | 164 767 | 180 848 |
| Fonds Diversified Income Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | | |
| Fonds Diversified Income Fund | Fonds US Short-Term Fund | | 292 138 | 543 791 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | 125 906 | 91 976 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | 294 | 6 812 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | 553 | 0 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Fonds US Short-Term Fund | | 30 083 | 36 205 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | 582 847 | 807 621 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | | |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Fonds US Short-Term Fund | | 48 624 | 79 870 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | 6 390 | 1 485 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Fonds Income Fund | | 178 210 | 167 588 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | 6 958 | 221 744 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | 2 109 019 | 2 011 347 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | | 2 067 913 | 1 848 262 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | 25 852 | 14 875 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | 61 273 | 69 280 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | 309 974 | 335 553 |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | | |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds Global Bond Ex-US Fund | | 201 | 438 |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | 180 164 | 223 394 |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds UK Corporate Bond Fund | | 4 420 | 46 712 |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds US Short-Term Fund | | 13 601 | 35 617 |
| Fonds Global Bond Fund | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | 128 093 | 68 326 |
| Fonds Global Bond ESG Fund | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | 0 | 19 129 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Fonds PIMCO Europe Short-Term Opportunities Fund | | 38 106 | 6 260 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Fonds PIMCO Europe Short-Term Opportunities Fund | | 22 879 | 49 585 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Fonds Global Advantage Fund | | 193 037 | 193 315 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Fonds Global Bond Fund | | 1 052 935 | 954 631 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Fonds Global Bond ESG Fund | | 16 867 | 7 052 |
| Fonds Low Average Duration Fund | Fonds Global Bond Ex-US Fund | | 472 308 | 509 072 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Fonds Global High Yield Bond Fund | | 932 168 | 1 029 720 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Fonds Global Investment Grade Credit Fund | | 653 589 | 694 588 |
| Fonds Total Return Bond Fund | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | 183 318 | 17 127 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | Fonds Global Low Duration Real Return Fund | | 440 384 | 452 300 |
| | Fonds Global Real Return Fund | | 601 440 | 585 100 |
| | Fonds Income Fund | | 6 903 065 | 7 658 041 |
| | Fonds Income Fund II | | 89 181 | 90 800 |
| | Fonds Inflation Multi-Asset Fund | | 101 542 | 139 282 |
| | Fonds Low Average Duration Fund | | 289 291 | 330 729 |
| | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | 473 839 | 422 997 |
| | Fonds Low Duration Income Fund | | 223 766 | 120 527 |
| | Fonds Low Duration Opportunities Fund | | 257 020 | 342 744 |
| | Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | | 2 724 | 4 900 |
| | Fonds Mortgage Opportunities Fund | | 1 | 685 |
| | Fonds StocksPLUS™ Fund | | 144 724 | 58 500 |
| | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | | 535 | 400 |
| | Fonds Strategic Income Fund | | 207 690 | 235 600 |
| | Fonds Total Return Bond Fund | | 1 385 892 | 1 535 535 |
| | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | 209 410 | 227 603 |
| | Fonds UK Corporate Bond Fund | | 54 220 | 23 515 |
| | Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | 14 950 | 3 832 |
| | Fonds US High Yield Bond Fund | | 909 930 | 845 525 |
| | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | | 150 534 | 148 627 |
| | Fonds US Short-Term Fund | | 100 320 | 128 304 |

Certains Fonds investissent dans la Catégorie Z du Fonds PIMCO China Bond Fund, un Fonds de PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. et du Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, un Fonds de PIMCO Select Funds plc, qui sont considérés comme des Fonds affiliés. Du fait de la nature de la Catégorie Z et dans le but d'éviter le doublement des frais, les Frais de gestion de la Catégorie Z des deux fonds sont fixés à 0,00 % par an.

Certains Fonds investissent dans les Fonds PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF et PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, des Fonds de PIMCO ETFs plc, qui sont considérés comme des Fonds affiliés. Comme ces Fonds ne comportent pas de catégorie d'actions sans frais, les Frais de gestion sont supportés par le Fonds investissant et par le Fonds affilié sous-jacent. En conséquence, un Abandon de frais de conseil en investissement est déduit avant paiement par le Fonds investissant au Gestionnaire et comptabilisé à la rubrique Remboursement effectué par les Conseillers en investissement du Compte de résultat.

Au cours des exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022, les Fonds ci-dessous ont exercé des activités d'achat et de vente de titres dans des Fonds affiliés, d'achats et de ventes liés à des investissements croisés et d'achats et de ventes d'investissements dans des Fonds affiliés (montants en milliers) :

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | 31 décembre 2022 | |
|--|------------------|------------|
| | Achats | Ventes |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | \$ 908 623 | \$ 895 972 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 129 084 | 124 231 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 680 984 | 811 602 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | 190 635 | 542 608 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | 449 | 22 179 |
| Fonds Commodity Real Return Fund | 85 291 | 5 900 |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 5 183 | 8 342 |
| Fonds Diversified Income Fund | 638 902 | 1 645 597 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | 75 129 | 141 980 |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | 200 | 200 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | 441 881 | 264 103 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | 104 045 | 26 348 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | 1 837 395 | 1 892 204 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 1 462 642 | 1 981 418 |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | 210 705 | 83 931 |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | 92 941 | 88 297 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 119 731 | 128 393 |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 1 000 | 1 438 |
| Fonds Euro Bond Fund | 265 381 | 223 907 |
| Fonds Euro Credit Fund | 80 580 | 117 241 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | 254 310 | 373 646 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | 19 622 | 16 672 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | 71 651 | 76 393 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | 12 406 | 8 873 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 39 660 | 47 565 |
| Fonds Global Advantage Fund | 153 288 | 145 735 |
| Fonds Global Bond Fund | 1 056 550 | 1 129 083 |
| Fonds Global Bond ESG Fund | 9 751 | 15 801 |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | 641 210 | 604 043 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 727 445 | 1 125 258 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 3 785 028 | 4 629 158 |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | 87 522 | 194 414 |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 232 291 | 226 698 |
| Fonds Global Real Return Fund | 837 486 | 812 145 |
| Fonds Income Fund | 1 603 346 | 2 928 690 |
| Fonds Income Fund II | 15 740 | 16 700 |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | 87 463 | 56 410 |
| Fonds Low Average Duration Fund | 552 743 | 550 289 |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 359 824 | 340 371 |
| Fonds Low Duration Income Fund | 181 275 | 178 894 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 491 198 | 704 279 |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | 100 | 100 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 21 008 | 18 700 |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | 1 108 810 | 1 242 395 |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | 150 012 | 544 833 |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 410 | 600 |
| Fonds Strategic Income Fund | 339 690 | 329 066 |
| Fonds Total Return Bond Fund | 447 487 | 642 290 |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 116 658 | 79 650 |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | 12 034 | 18 983 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | 33 666 | 11 074 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | 909 401 | 1 318 576 |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | 344 028 | 348 295 |
| Fonds US Short-Term Fund | 498 555 | 563 279 |

Le tableau ci-après présente la valeur des actions en circulation détenues par le groupe Allianz, les Fonds de la Société, les Fonds affiliés et les employés des Conseillers en investissement, parties liées de la Société, au-delà de 20 % de l'actif net du Fonds, au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022.

| Fonds | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
|---|------------------|------------------|
| | % Détenu | % Détenu |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | S/O | 21,53 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 59,45 | 49,24 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 66,02 | 65,44 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | 20,61 | 23,94 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | S/O | 21,78 |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 28,67 | 25,65 |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | 100,00 | 100,00 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | 36,16 | 25,10 |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | S/O | 100,00 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 26,97 | 22,87 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 54,67 | 57,57 |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 28,10 | 26,22 |
| Fonds Euro Credit Fund | 24,54 | 30,16 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | 26,70 | 21,29 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | 36,04 | S/O |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | 70,58 | 98,78 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 27,59 | 31,55 |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | 21,50 | S/O |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 23,27 | S/O |
| Fonds Income Fund II | 20,21 | 40,67 |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | 26,11 | 29,48 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 35,72 | S/O |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | 100,00 | 100,00 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 56,87 | 50,65 |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 79,44 | 84,86 |
| Fonds Strategic Income Fund | 46,69 | 47,13 |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 25,56 | S/O |
| Fonds US Short-Term Fund | 35,03 | 31,95 |

Les Fonds dont les actionnaires, à l'exception du Groupe Allianz, des Fonds de la Société, des Fonds affiliés à la Société et des employés des Conseillers en investissement, détiennent plus de 20 % de l'actif net du Fonds, sont indiqués séparément à la Note 16.

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds Income Fund a vendu des titres pour une valeur de 119 273 USD (31 décembre 2022 : 136 931 USD) à Repack Bond Collateral Ltd. (l'« Entité »), une société exonérée constituée sous la forme d'une société à responsabilité limitée en vertu des lois des Îles Caïmans, qui est une partie liée aux Conseillers en investissement. Aucune commission ne sera versée aux Conseillers en investissement par l'Entité. Au 31 décembre 2023, le Fonds Income Fund détenait 9 694 Billets (31 décembre 2022 : 9 694 Billets) de BNP Paribas Issuance BV., qui est garanti par des billets émis par l'Entité. Au cours de l'exercice, l'Entité a versé au Fonds Income Fund des distributions totales pour un montant de 73 836 USD (31 décembre 2022 : 43 624 USD).

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023, le Fonds PIMCO Trends Managed Futures Strategy Fund a investi dans deux billets structurés, Aries Capital DAC et Greenleaves Capital Designated Activity Co., dont le produit a été utilisé pour émettre des actions de participation rachetables de PIMCO Commodities Diversified SP, un portefeuille séparé de PIMCO Diversified Strategies SPC. PIMCO Diversified Strategies SPC, une société exonérée constituée sous la forme d'une société à responsabilité limitée en vertu des lois des Îles Caïmans, est une partie liée aux Conseillers en investissement. Aucune commission ne sera versée aux Conseillers en investissement par PIMCO Diversified Strategies SPC. Au 31 décembre 2023, la valeur des billets structurés détenus par le Fonds PIMCO Trends Managed Futures Strategy Fund était de 31 276 USD.

Intérêts des Administrateurs et du Secrétaire en actions et contrats

Au 31 décembre 2023, V. Mangala Ananthanarayanan détenait 8 187,77 (31 décembre 2022 : 8 187,77) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5 319,15 (31 décembre 2022 : 5 319,15) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, néant (31 décembre 2022 : 8 757,87) actions du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, 3 619,69 (31 décembre 2022 : 3 619,69) actions du Fonds Global Bond Fund et 27 543,65 (31 décembre 2022 : 27 543,65) actions du Fonds Income Fund, tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2023, Ryan P. Blute détenait néant (31 décembre 2022 : 5 387,93) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 28 827,68 (31 décembre 2022 : 24 131,27) actions du Fonds Low Average Duration Fund et 50 751,14 (31 décembre 2022 : 82 494,63) actions du Fonds Low Duration Income Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2023, Craig A. Dawson détenait 18 118,23 (31 décembre 2022 : 18 118,23) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 97 370,98 (31 décembre 2022 : 97 370,98) actions du Fonds Low Duration Income Fund et 92 850,51 (31 décembre 2022 : 92 850,51) actions du Fonds Low Duration Opportunities Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2023, David M. Kennedy détenait 16 786,79 (31 décembre 2022 : 16 786,79) actions du Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund et 4 186,59 (31 décembre 2022 : 4 449,56) actions du Fonds Emerging Markets Bond Fund, tous deux Fonds de la Société.

Aucun autre Administrateur ne détenait d'actions de la Société au cours des exercices clos le 31 décembre 2023 ou le 31 décembre 2022.

Le Secrétaire ne détenait pas d'actions de la Société au cours des exercices clos le 31 décembre 2023 ou le 31 décembre 2022.

La Société n'avait aucun employé au cours des exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

15. TAUX DE CHANGE

Aux fins de la consolidation des états financiers des Fonds pour la comptabilité de la Société (requise en vertu de la loi irlandaise sur les sociétés), les sommes figurant dans le Bilan ont été converties, au taux de change en vigueur au 31 décembre 2023, de l'euro au dollar américain (USD/EUR : 0,90526) (31 décembre 2022 : USD/EUR : 0,93699) et de la livre sterling au dollar américain (USD/GBP : 0,78444) (31 décembre 2022 : USD/GBP : 0,83132). Les montants du Compte de résultat et de l'État de l'évolution des actifs nets ont été convertis au taux de change moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2023, de l'euro au dollar américain (USD/EUR : 0,92495) (31 décembre 2022 : USD/EUR : 0,95111) et de la livre sterling au dollar américain (USD/GBP : 0,80449) (31 décembre 2022 : USD/GBP : 0,81159).

Le tableau suivant reflète les taux de change utilisés pour convertir la livre sterling, l'euro et le dollar américain, les devises fonctionnelles des Fonds de la Société, les investissements et autres actifs et passifs libellés dans des devises autres que la devise fonctionnelle de chaque Fonds.

Les taux de change du peso argentin (« ARS ») au 31 décembre 2023 comprennent une décote de 21 % (31 décembre 2022 : 83 %), en raison d'un écart entre les taux de change officiels de l'Argentine et les taux de change non officiels.

| Devise étrangère | 31 décembre 2023 | | |
|------------------|------------------|-----------|--------------|
| | EUR | GBP | USD |
| AED | S/O | S/O | 3,67275 |
| ARS | 1 077,45365 | S/O | 975,38000 |
| AUD | 1,61889 | 1,86825 | 1,46552 |
| BRL | 5,36595 | S/O | 4,85760 |
| CAD | 1,45659 | 1,68095 | 1,31860 |
| CHF | 0,92973 | 1,07294 | 0,84165 |
| CLP | 964,67439 | S/O | 873,28500 |
| CNH | 7,86577 | 9,07734 | 7,12060 |
| CNY | 7,83440 | S/O | 7,09220 |
| COP | 4 279,41462 | S/O | 3 874,00000 |
| CZK | 24,68849 | S/O | 22,34960 |
| DKK | 7,45457 | 8,60279 | 6,74835 |
| DOP | S/O | S/O | 58,06000 |
| EGP | S/O | S/O | 30,92500 |
| EUR (ou €) | 1,00000 | 1,15403 | 0,90526 |
| GBP (ou £) | 0,86653 | 1,00000 | 0,78444 |
| GHS | S/O | S/O | 11,91500 |
| HKD | 8,62572 | S/O | 7,80855 |
| HUF | 382,21508 | 441,08775 | 346,00555 |
| IDR | 17 008,29813 | S/O | 15 397,00000 |
| ILS | 3,97773 | S/O | 3,60090 |
| INR | 91,92208 | S/O | 83,21375 |
| JPY (ou ¥) | 155,73358 | 179,72125 | 140,98000 |
| KES | S/O | S/O | 157,00000 |
| KRW | 1 422,67891 | S/O | 1 287,90000 |
| KZT | S/O | S/O | 455,89000 |
| MXN | 18,70670 | 21,58809 | 16,93450 |
| MYR | S/O | S/O | 4,59500 |
| NGN | S/O | S/O | 897,50000 |
| NOK | 11,21850 | 12,94648 | 10,15570 |
| NZD | 1,74469 | 2,01342 | 1,57941 |
| PEN | 4,09008 | S/O | 3,70260 |
| PHP | S/O | S/O | 55,37500 |
| PLN | 4,34376 | S/O | 3,93225 |
| QAR | S/O | S/O | 3,64100 |
| RON | S/O | S/O | 4,50360 |
| RSD | S/O | S/O | 106,13000 |
| RUB | 98,75572 | S/O | 89,40000 |
| SEK | 11,13250 | 12,84724 | 10,07785 |

| Devise étrangère | 31 décembre 2023 | | |
|------------------|------------------|----------|--------------|
| | EUR | GBP | USD |
| SGD | 1,45714 | 1,68159 | 1,31910 |
| THB | S/O | S/O | 34,13250 |
| TRY | 32,62474 | 37,64993 | 29,53400 |
| TWD | 33,90226 | S/O | 30,69050 |
| UGX | S/O | S/O | 3 780,00000 |
| USD (ou \$) | 1,10465 | 1,27480 | 1,00000 |
| UYU | S/O | S/O | 39,04000 |
| VND | S/O | S/O | 24 262,00000 |
| ZAR | 20,20129 | 23,31290 | 18,28750 |
| ZMW | S/O | S/O | 25,71030 |

| Devise étrangère | 31 décembre 2022 | | |
|------------------|------------------|-----------|--------------|
| | EUR | GBP | USD |
| AED | S/O | S/O | 3,67265 |
| ARS | 346,74937 | S/O | 324,90000 |
| AUD | 1,57377 | 1,77380 | 1,47460 |
| BRL | 5,63481 | S/O | 5,27975 |
| CAD | 1,44607 | 1,62987 | 1,35495 |
| CHF | 0,98742 | S/O | 0,92520 |
| CLP | 909,24323 | S/O | 851,95000 |
| CNH | 7,38414 | 8,32269 | 6,91885 |
| CNY | 7,41920 | 8,36220 | 6,95170 |
| COP | 5 174,97022 | S/O | 4 848,88500 |
| CZK | 24,15399 | S/O | 22,63200 |
| DKK | 7,43643 | 8,38163 | 6,96785 |
| DOP | S/O | S/O | 56,22000 |
| EGP | S/O | S/O | 24,75500 |
| EUR (ou €) | 1,00000 | 1,12710 | 0,93699 |
| GBP (ou £) | 0,88723 | 1,00000 | 0,83132 |
| GHS | S/O | S/O | 10,20000 |
| HKD | 8,32983 | S/O | 7,80495 |
| HUF | 400,44985 | S/O | 375,21670 |
| IDR | 16 614,40701 | S/O | 15 567,50000 |
| ILS | 3,76579 | S/O | 3,52850 |
| INR | 88,29355 | S/O | 82,73000 |
| JPY (ou ¥) | 140,81824 | 158,71670 | 131,94500 |
| KES | S/O | S/O | 123,40000 |
| KRW | 1 349,53703 | S/O | 1 264,50000 |
| KZT | S/O | S/O | 462,72000 |
| MXN | 20,79776 | 23,44122 | 19,48725 |
| MYR | S/O | S/O | 4,40500 |
| NGN | S/O | S/O | 460,75000 |
| NOK | 10,51348 | 11,84977 | 9,85100 |
| NZD | 1,68748 | 1,90197 | 1,58115 |
| PEN | 4,06996 | S/O | 3,81350 |
| PHP | S/O | S/O | 55,72750 |
| PLN | 4,68122 | S/O | 4,38625 |
| RON | S/O | S/O | 4,63605 |
| RSD | S/O | S/O | 109,92500 |
| RUB | 77,90922 | S/O | 73,00000 |
| SEK | 11,12021 | 12,53362 | 10,41950 |
| SGD | 1,43140 | 1,61333 | 1,34120 |
| THB | S/O | S/O | 34,63500 |
| TRY | 19,97838 | 22,51769 | 18,71950 |
| TWD | 32,80245 | S/O | 30,73550 |
| UGX | S/O | S/O | 3 720,00000 |
| USD (ou \$) | 1,06725 | 1,20290 | 1,00000 |
| UYU | S/O | S/O | 39,76500 |
| VND | S/O | S/O | 23 575,00000 |
| ZAR | 18,15925 | S/O | 17,01500 |
| ZMW | S/O | S/O | 18,07500 |

16. RISQUES FINANCIERS

Les principaux risques relatifs aux instruments financiers de la Société sont le risque de marché, le risque de change, le risque de taux d'intérêt, le risque de liquidité, le risque de crédit et le risque de contrepartie.

(a) Risque de marché

Le risque de marché découle essentiellement des incertitudes relatives aux cours futurs des instruments financiers détenus. Il représente la perte potentielle que chaque Fonds peut encourir sur ses positions de marché face à des fluctuations négatives des cours. Les Conseillers en investissement tiennent compte de la répartition des actifs du portefeuille afin de minimiser le risque inhérent à certains pays ou secteurs d'activité, tout en poursuivant les objectifs d'investissement des Fonds.

Les Conseillers en investissement font appel à un certain nombre de techniques quantitatives pour évaluer l'impact des risques de marché, y compris les événements de crédit, les fluctuations des taux d'intérêt, les écarts de crédit et les valeurs de recouvrement sur le portefeuille d'investissement des Fonds.

Les Conseillers en investissement appliquent l'analyse de la Valeur à risque, (« VaR »), technique largement utilisée par les institutions financières afin de quantifier, évaluer et communiquer les risques de marché.

La Valeur à risque est un cadre statistique qui soutient la quantification du risque de marché au sein d'un portefeuille à un intervalle de confiance particulier sur une période de détention définie. Certains Fonds peuvent utiliser le modèle de la VaR relative ou de la VaR absolue. S'ils utilisent le modèle de la VaR relative, la VaR du portefeuille du Fonds ne doit pas dépasser le double de la VaR d'un portefeuille comparable ou d'un portefeuille de référence (un portefeuille similaire ne comportant pas de produits dérivés) reflétant le style d'investissement recherché par le Fonds. S'ils utilisent le modèle de la VaR absolue, la VaR du portefeuille du Fonds ne peut dépasser 20 % de la Valeur Nette d'Inventaire du Fonds, la période de détention doit être de 20 jours et la durée des données historiques ne doit pas être inférieure à un an. La Valeur à risque cherche à quantifier les pertes minimums, maximums et moyennes anticipées en dollars qui peuvent résulter du comportement interactif de tous les prix de marchés importants, des écarts, des volatilités, des taux et d'autres risques, y compris le risque de change, le risque de taux d'intérêt, le risque lié aux marchés émergents et le risque de convexité, fondés sur les relations historiques observées entre ces marchés.

Bien que le recours aux instruments financiers dérivés puisse créer une exposition supplémentaire à l'effet de levier, toute exposition de la sorte sera couverte et gérée, en matière de risque, par la méthode de la Valeur à risque, conformément aux prescriptions de la Banque centrale d'Irlande. Les Conseillers en investissement surveillent le risque de portefeuille en utilisant des expositions aux facteurs de marché sur une base journalière. Le risque de marché potentiel est calculé en utilisant l'approche paramétrique delta-normale et la modélisation de facteurs. La Valeur à risque est calculée et transmise automatiquement chaque jour en utilisant les prix de clôture et les informations sur le marché des derniers jours ouvrables. En fonction de l'application des statistiques de risque,

différents niveaux de confiance (tel que 99 %) et d'horizons temporels (semaines ou mois) peuvent être sélectionnés.

Des tests de résistance sont également menés mensuellement concernant le modèle de la VaR pour chaque Fonds. Le Groupe dédié au risque de PIMCO supervise la composition des tests de résistance et effectue les corrections appropriées lorsque les conditions de marché ou les compositions des fonds le requièrent. Les tests de résistance évaluent les gains ou pertes potentiels dérivant de chocs sur les variables financières notamment les taux souverains nominaux, les taux de swap nominaux, les taux réels, les écarts de crédit, les valorisations boursières, les valeurs des matières premières, les taux de change, et les volatilités implicites. Outre les tests de résistance mensuels, trois tests de résistance supplémentaires sont également menés, certains sont utilisés quotidiennement et certains sont utilisés à des fins d'analyse de façon interactive. Le premier consiste en des tests de durée qui évaluent les répercussions sur la valeur d'un portefeuille si des mouvements non anticipés dans les rendements se produisent sur le marché. Ces durées sont calculées chaque jour ouvrable. Le deuxième test implique une base de données de scénarios historiques de crises qui peuvent être exécutés pour tester les réactions aux tests de ces crises. Les scénarios de crise historique contiennent de nombreux changements imprévus des conditions de marché et des matrices de corrélation. Le troisième test consiste en des matrices de corrélation qui peuvent être modifiées manuellement afin de refléter les conditions qui peuvent avoir lieu à l'avenir mais qui ne se sont pas encore produites.

Les calculs sont généralement effectués à l'aide de méthodologies de simulation automatisées. Cependant, il existe également des méthodologies afin de vérifier manuellement quels changements dans les matrices de corrélation auraient un important impact négatif sur les portefeuilles. Ces changements de corrélations peuvent ensuite être analysés et des événements réels possibles pouvant provoquer de tels changements peuvent être attribués.

Bien entendu, il ne peut être exclu que les résultats économiques réels diffèrent considérablement des scénarios manuels et automatisés.

Les mesures quotidiennes de la VaR constituent une estimation de la perte du portefeuille sur le mois suivant qui ne serait pas supérieure à 99 % de la période, par rapport aux hypothèses du modèle de la VaR.

La Valeur à risque ne couvre pas tous les risques auxquels le portefeuille peut être exposé. Plus particulièrement, le cadre ne vise pas à inclure le risque de liquidité, le risque de contrepartie ou les incidents de crédit extrêmes, tels que la défaillance d'un émetteur. En pratique, les résultats actuels des transactions différeront de la Valeur à risque et peuvent ne pas fournir une indication correcte des gains et pertes dans des conditions de marché tendues. Afin de déterminer la fiabilité des modèles de Valeur à risque, les résultats réels sont surveillés afin de tester la validité des hypothèses et des paramètres utilisés dans le calcul de la Valeur à risque. Les positions de risque de marché sont également soumises à des tests de résistance réguliers afin de s'assurer que le Fonds puisse supporter un événement de marché extrême.

Les tableaux suivants présentent les VaR minimums, maximums, moyennes et de fin d'exercice de chaque Fonds aux 31 décembre 2023 et 31 décembre 2022 :

| Fonds | Méthodologie | Indice de référence | 31 décembre 2023 | | | |
|---|--------------|--|------------------|----------|----------|----------------|
| | | | Min | Max | Moyenne | Fin d'exercice |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index | 88,07 % | 105,72 % | 96,15 % | 90,32 % |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan Asia Credit Index | 94,58 % | 109,74 % | 102,04 % | 98,53 % |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Relative | 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index | 91,37 % | 111,74 % | 101,12 % | 100,27 % |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | Absolute | S/O | 2,95 % | 10,88 % | 6,50 % | 5,53 % |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | Absolute | S/O | 2,99 % | 4,51 % | 3,51 % | 3,53 % |
| Fonds Commodity Real Return Fund | Relative | Indice Bloomberg Commodity Index Total Return | 100,62 % | 112,87 % | 110,08 % | 110,54 % |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Absolute | S/O | 3,13 % | 6,49 % | 3,94 % | 3,82 % |
| Fonds Diversified Income Fund | Relative | 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD) | 94,91 % | 108,65 % | 101,06 % | 100,63 % |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Absolute | S/O | 3,49 % | 6,90 % | 4,97 % | 4,29 % |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | Relative | 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified | 97,58 % | 112,32 % | 103,74 % | 102,47 % |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Absolute | S/O | 2,54 % | 6,10 % | 3,88 % | 4,07 % |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Absolute | S/O | 3,63 % | 7,24 % | 5,31 % | 6,84 % |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert) | 101,51 % | 113,57 % | 107,23 % | 109,65 % |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | Relative | Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index | 98,66 % | 112,88 % | 104,84 % | 110,12 % |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 102,04 % | 111,88 % | 105,82 % | 108,20 % |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | Relative | Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified | 100,33 % | 112,08 % | 106,06 % | 107,41 % |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) | 97,59 % | 112,78 % | 103,64 % | 108,05 % |

| Fonds | Méthodologie | Indice de référence | 31 décembre 2023 | | | |
|--|--------------|---|------------------|----------|----------|----------------|
| | | | Min | Max | Moyenne | Fin d'exercice |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Relative | 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index et 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD) | 43,33 % | 104,86 % | 69,48 % | 88,91 % |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Relative | Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert) | 100,20 % | 120,45 % | 110,81 % | 115,94 % |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | Absolue | S/O | 3,07 % | 5,00 % | 3,68 % | 3,20 % |
| Fonds Euro Bond Fund | Relative | Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index | 91,91 % | 107,33 % | 99,13 % | 100,03 % |
| Fonds Euro Credit Fund | Relative | Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index | 98,90 % | 114,22 % | 103,70 % | 104,64 % |
| Fonds Euro Income Bond Fund | Absolue | S/O | 4,64 % | 7,59 % | 5,67 % | 5,68 % |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | Relative | Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index | 1,13 % | 101,75 % | 98,89 % | 100,04 % |
| Fonds Euro Short-Term Fund | Absolue | S/O | 0,73 % | 1,75 % | 1,19 % | 0,73 % |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index | 96,20 % | 118,47 % | 103,91 % | 102,03 % |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Absolue | S/O | 0,02 % | 3,31 % | 2,49 % | 2,07 % |
| Fonds Global Advantage Fund | Relative | Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres) | 101,21 % | 115,89 % | 108,24 % | 103,64 % |
| Fonds Global Bond Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) | 93,30 % | 117,72 % | 106,32 % | 105,78 % |
| Fonds Global Bond ESG Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) | 93,79 % | 119,10 % | 106,57 % | 104,94 % |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) | 92,42 % | 117,07 % | 106,62 % | 106,44 % |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD | 53,99 % | 110,74 % | 102,89 % | 105,10 % |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) | 85,12 % | 117,09 % | 102,94 % | 100,81 % |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) | 98,08 % | 114,86 % | 104,25 % | 102,09 % |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | Relative | Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD) | 100,72 % | 266,63 % | 109,50 % | 107,11 % |
| Fonds Global Real Return Fund | Relative | Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD) | 97,02 % | 120,62 % | 101,63 % | 101,30 % |
| Fonds Income Fund | Absolue | S/O | 4,77 % | 7,88 % | 5,96 % | 5,12 % |
| Fonds Income Fund II | Absolue | S/O | 3,66 % | 6,34 % | 4,52 % | 4,08 % |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | Absolue | S/O | 5,90 % | 8,28 % | 7,14 % | 7,13 % |
| Fonds Low Average Duration Fund | Absolue | S/O | 2,55 % | 4,05 % | 2,94 % | 2,87 % |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD) | 91,75 % | 123,35 % | 106,87 % | 113,39 % |
| Fonds Low Duration Income Fund | Absolue | S/O | 3,41 % | 5,75 % | 4,60 % | 3,53 % |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Absolue | S/O | 2,04 % | 8,79 % | 3,12 % | 2,98 % |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | Absolue | S/O | 1,26 % | 2,67 % | 1,83 % | 1,58 % |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Relative | Indice Alerian MLP Index | 98,02 % | 109,97 % | 104,87 % | 98,02 % |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | Absolue | S/O | 4,34 % | 7,09 % | 5,68 % | 6,36 % |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | Relative | Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes) | 99,66 % | 104,59 % | 102,15 % | 101,89 % |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Relative | Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes) | 105,20 % | 111,02 % | 106,91 % | 106,86 % |
| Fonds Strategic Income Fund | Relative | 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index et 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index | 105,46 % | 127,84 % | 117,47 % | 105,46 % |
| Fonds Total Return Bond Fund | Relative | Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index | 94,74 % | 116,39 % | 103,12 % | 99,26 % |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Absolue | S/O | 1,71 % | 11,63 % | 6,06 % | 8,88 % |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index | 100,97 % | 107,90 % | 104,53 % | 101,51 % |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index | 99,65 % | 104,66 % | 101,90 % | 102,62 % |
| Fonds US High Yield Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index | 56,30 % | 109,71 % | 101,47 % | 103,73 % |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | Relative | Indice Bloomberg U.S. Credit Index | 91,71 % | 110,47 % | 98,40 % | 95,25 % |
| Fonds US Short-Term Fund | Absolue | S/O | 0,52 % | 1,11 % | 0,80 % | 0,52 % |

| Fonds | Méthodologie | Indice de référence | 31 décembre 2022 | | | |
|---|--------------|--|------------------|----------|----------|----------------|
| | | | Min | Max | Moyenne | Fin d'exercice |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index | 86,03 % | 109,37 % | 96,86 % | 88,69 % |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan Asia Credit Index | 91,44 % | 106,49 % | 99,71 % | 94,95 % |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Relative | 60 % de l'Indice MSCI All Country World Index et 40 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index couvert en USD | 90,26 % | 127,43 % | 103,81 % | 93,05 % |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | Absolue | S/O | 4,38 % | 11,46 % | 8,28 % | 8,49 % |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | Méthodologie | Indice de référence | 31 décembre 2022 | | | |
|--|--------------|--|------------------|----------|----------|----------------|
| | | | Min | Max | Moyenne | Fin d'exercice |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | Absolue | S/O | 2,13 % | 4,93 % | 3,81 % | 4,03 % |
| Fonds Commodity Real Return Fund | Relative | Indice Bloomberg Commodity Index Total Return | 100,90 % | 112,80 % | 105,31 % | 108,93 % |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Absolue | S/O | 2,06 % | 5,50 % | 3,99 % | 4,51 % |
| Fonds Diversified Income Fund | Relative | 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets Index (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global Index (couvert en USD) | 96,68 % | 132,63 % | 110,21 % | 98,82 % |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Absolue | S/O | 5,07 % | 9,35 % | 7,23 % | 5,76 % |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | Relative | 1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified | 101,85 % | 109,31 % | 104,88 % | 102,63 % |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Absolue | S/O | 2,61 % | 5,75 % | 4,52 % | 4,17 % |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Absolue | S/O | 3,85 % | 7,74 % | 5,08 % | 5,84 % |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert) | 94,06 % | 106,90 % | 102,72 % | 102,61 % |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | Relative | Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index | 92,69 % | 108,54 % | 97,67 % | 99,38 % |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 97,07 % | 110,86 % | 104,27 % | 102,74 % |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | Relative | Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified | 98,21 % | 112,18 % | 105,42 % | 100,17 % |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | Relative | Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) | 94,77 % | 125,73 % | 109,89 % | 98,72 % |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Relative | 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index et 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD) | 35,81 % | 87,96 % | 56,92 % | 55,69 % |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Relative | Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert) | 84,87 % | 113,34 % | 104,07 % | 109,06 % |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | Absolue | S/O | 1,77 % | 4,63 % | 3,24 % | 3,81 % |
| Fonds Euro Bond Fund | Relative | Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index | 91,45 % | 107,79 % | 101,40 % | 102,69 % |
| Fonds Euro Credit Fund | Relative | Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index | 102,32 % | 122,65 % | 110,14 % | 104,97 % |
| Fonds Euro Income Bond Fund | Absolue | S/O | 2,86 % | 7,88 % | 5,99 % | 5,55 % |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | Relative | Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index | 94,30 % | 102,20 % | 99,42 % | 100,39 % |
| Fonds Euro Short-Term Fund | Absolue | S/O | 0,66 % | 2,13 % | 1,56 % | 1,43 % |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index | 90,65 % | 106,11 % | 99,81 % | 101,48 % |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Absolue | S/O | 2,42 % | 4,11 % | 3,18 % | 3,32 % |
| Fonds Global Advantage Fund | Relative | Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres) | 98,46 % | 115,01 % | 106,86 % | 102,35 % |
| Fonds Global Bond Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) | 86,07 % | 112,02 % | 101,52 % | 102,14 % |
| Fonds Global Bond ESG Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) | 86,26 % | 111,08 % | 101,39 % | 101,93 % |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) | 82,61 % | 114,31 % | 102,72 % | 103,34 % |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD | 96,87 % | 122,97 % | 105,69 % | 100,40 % |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) | 97,59 % | 116,74 % | 105,84 % | 101,83 % |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) | 97,83 % | 113,48 % | 105,86 % | 101,23 % |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | Relative | Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD) | 89,75 % | 119,66 % | 104,44 % | 110,21 % |
| Fonds Global Real Return Fund | Relative | Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD) | 92,16 % | 107,84 % | 100,44 % | 103,88 % |
| Fonds Income Fund | Absolue | S/O | 3,83 % | 8,45 % | 6,51 % | 7,34 % |
| Fonds Income Fund II | Absolue | S/O | 1,92 % | 5,97 % | 4,25 % | 5,62 % |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | Absolue | S/O | 6,06 % | 9,75 % | 7,46 % | 8,71 % |
| Fonds Low Average Duration Fund | Absolue | S/O | 1,57 % | 3,31 % | 2,68 % | 3,00 % |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Relative | Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD) | 82,83 % | 112,84 % | 101,24 % | 102,69 % |
| Fonds Low Duration Income Fund | Absolue | S/O | 2,98 % | 6,99 % | 5,29 % | 5,80 % |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Absolue | S/O | 1,82 % | 5,47 % | 3,70 % | 3,23 % |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | Absolue | S/O | 0,96 % | 2,14 % | 1,77 % | 1,76 % |

| Fonds | Méthodologie | Indice de référence | 31 décembre 2022 | | | |
|--|--------------|--|------------------|----------|----------|----------------|
| | | | Min | Max | Moyenne | Fin d'exercice |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Relative | Indice Alerian MLP Index | 92,23 % | 109,76 % | 102,35 % | 108,22 % |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | Absolue | S/O | 2,75 % | 8,49 % | 6,19 % | 6,01 % |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | Relative | Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes) | 97,48 % | 106,40 % | 101,95 % | 101,54 % |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Relative | Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes) | 101,28 % | 112,10 % | 107,00 % | 107,82 % |
| Fonds Strategic Income Fund | Relative | 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index et 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index | 106,90 % | 144,99 % | 119,86 % | 125,90 % |
| Fonds Total Return Bond Fund | Relative | Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index | 95,33 % | 113,77 % | 103,98 % | 100,51 % |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Absolue | S/O | 1,91 % | 11,57 % | 6,10 % | 2,57 % |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index | 97,22 % | 110,46 % | 104,62 % | 105,19 % |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index | 95,87 % | 110,22 % | 100,56 % | 102,14 % |
| Fonds US High Yield Bond Fund | Relative | Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index | 96,48 % | 122,58 % | 104,73 % | 100,25 % |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | Relative | Indice Bloomberg U.S. Credit Index | 94,56 % | 112,79 % | 102,51 % | 95,83 % |
| Fonds US Short-Term Fund | Absolue | S/O | 0,67 % | 1,58 % | 1,13 % | 1,08 % |

La Banque centrale exige de tous les fonds qu'ils présentent une mesure de leur endettement calculée sur la base de l'exposition notionnelle brute. L'exposition notionnelle brute est calculée à partir de la somme des valeurs absolues des montants notionnels des instruments financiers dérivés (réputée comprendre certaines opérations de règlement à terme), comme l'exige la Banque centrale et, de ce fait, ne prend pas en considération les arrangements de compensation et de couverture mis en place par le Fonds à tout moment. L'utilisation d'instruments financiers dérivés, que ce soit à des fins de couverture ou d'investissement, peut donner lieu à une exposition notionnelle brute plus importante. L'exposition notionnelle brute du Fonds augmente normalement lorsque, par exemple, les Conseillers en investissement estiment plus approprié d'utiliser des instruments financiers dérivés pour modifier l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, de change ou de crédit.

Le tableau suivant présente le niveau d'exposition notionnelle brute moyen des Fonds pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 31 décembre 2022 :

| Fonds | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
|---|------------------|----------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | 44 % | 46 % |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 41 % | 47 % |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 137 % | 267 % |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | 102 % | 104 % |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | 115 % | 81 % |
| Fonds Commodity Real Return Fund | 311 % | 258 % |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 92 % | 145 % |
| Fonds Diversified Income Fund | 117 % | 118 % |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | 174 % | 119 % |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | 74 % | 79 % ⁽¹⁾ |
| Fonds Dynamic Bond Fund | 214 % | 232 % |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | 279 % | 229 % |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | 330 % | 500 % |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | 163 % | 123 % ⁽¹⁾ |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 95 % | 80 % |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | 86 % | 61 % |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | 64 % | 46 % |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 566 % | 461 % |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 349 % | 465 % |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | 214 % | 120 % |
| Fonds Euro Bond Fund | 224 % | 227 % |
| Fonds Euro Credit Fund | 95 % | 118 % |
| Fonds Euro Income Bond Fund | 278 % | 177 % |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | 215 % | 265 % |
| Fonds Euro Short-Term Fund | 124 % | 124 % |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | 73 % | 58 % |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 276 % | 302 % |
| Fonds Global Advantage Fund | 445 % | 398 % |
| Fonds Global Bond Fund | 411 % | 404 % |

| Fonds | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
|--|------------------|---------------------|
| Fonds Global Bond ESG Fund | 323 % | 321 % |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | 458 % | 454 % |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 39 % | 30 % |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 86 % | 127 % |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | 95 % | 76 % |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 182 % | 198 % |
| Fonds Global Real Return Fund | 214 % | 232 % |
| Fonds Income Fund | 343 % | 243 % |
| Fonds Income Fund II | 100 % | 84 % |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | 274 % | 185 % |
| Fonds Low Average Duration Fund | 165 % | 147 % |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 82 % | 105 % |
| Fonds Low Duration Income Fund | 299 % | 249 % |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 299 % | 252 % |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | 98 % | 87 % ⁽¹⁾ |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 53 % | 49 % |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | 562 % | 569 % |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | 179 % | 201 % |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 301 % | 262 % |
| Fonds Strategic Income Fund | 353 % | 264 % |
| Fonds Total Return Bond Fund | 177 % | 181 % |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 1101 % | 818 % |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | 68 % | 79 % |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | 49 % | 90 % |
| Fonds US High Yield Bond Fund | 13 % | 6 % |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | 77 % | 111 % |
| Fonds US Short-Term Fund | 55 % | 87 % |

⁽¹⁾ Les Fonds ont été lancés au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022.

(b) Risque de change

Si les Fonds investissent directement dans des devises étrangères ou des titres qui se négocient dans, et perçoivent des revenus dans des devises étrangères ou dans des instruments financiers dérivés qui apportent une exposition à des devises étrangères, ils seront soumis au risque que ces devises se déprécient par rapport à la devise fonctionnelle des Fonds ou, dans le cas des positions de couverture, que la devise fonctionnelle des Fonds perde de la valeur par rapport à la devise couverte. Les taux de change peuvent fluctuer de manière significative sur de courtes périodes pour plusieurs raisons, dont les fluctuations des taux d'intérêt, l'intervention (ou la non-intervention) des gouvernements américain et étrangers, des banques centrales ou des entités supranationales comme le Fonds monétaire international, ou par l'imposition de contrôles des changes ou autres développements politiques aux États-Unis ou à l'étranger. Les investissements des Fonds dans des titres libellés en devise étrangère peuvent donc réduire les rendements des Fonds.

Notes relatives aux États financiers (suite)

Les Fonds PIMCO Capital Securities Fund, PIMCO Climate Bond Fund, Commodity Real Return Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Diversified Income Fund, Diversified Income ESG Fund, Emerging Markets Bond Fund, Emerging Markets Bond ESG Fund, Emerging Markets Corporate Bond Fund, PIMCO ESG Income Fund, Euro Short-Term Fund, PIMCO European High Yield Bond Fund, Global High Yield Bond Fund, Global Investment Grade Credit Fund, Global Investment Grade Credit ESG Fund, Global Low Duration Real Return Fund, Global Real Return Fund, Low Average Duration Fund, Low Duration Global Investment Grade Credit Fund, Low Duration Opportunities ESG Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, Mortgage Opportunities Fund, StocksPLUS™ Fund, Total Return Bond Fund, US High Yield Bond Fund, US Investment Grade Corporate Bond Fund et US Short-Term Fund n'avaient pas d'exposition significative au risque de change au 31 décembre 2023 ou au 31 décembre 2022. Les tableaux suivants présentent l'exposition totale au risque de change dans les devises si cette exposition est jugée importante (c'est-à-dire, toutes autres variables étant égales, l'impact d'un mouvement raisonnablement possible du taux de change occasionnerait un mouvement important de l'actif net) (en milliers) :

| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | | | | | |
|---|-------------|---------------|---------------------|-------------|---------------|-------------|
| Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Peso philippin | \$ (59 706) | \$ (13 937) | \$ (73 643) | \$ 0 | \$ (14 417) | \$ (14 417) |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Peso philippin | \$ (4 617) | \$ (1 035) | \$ (5 652) | \$ 0 | \$ (1 595) | \$ (1 595) |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar australien | \$ 1 007 | \$ 1 719 | \$ 2 726 | \$ 1 028 | \$ 15 689 | \$ 16 717 |
| Livre sterling britannique | 13 565 | (159) | 13 406 | 4 933 | (8 625) | (3 692) |
| Renminbi chinois (Chine continentale) | 1 673 | 760 | 2 433 | 21 768 | 117 | 21 885 |
| Renminbi chinois (Offshore) | 39 | (325) | (286) | 0 | (22 761) | (22 761) |
| Euro | 57 118 | (13 525) | 43 593 | 20 531 | 49 355 | 69 886 |
| Dollar de Hong Kong | 14 390 | 882 | 15 272 | 453 | 1 635 | 2 088 |
| Yen japonais | 31 782 | 6 203 | 37 985 | 161 033 | (134 205) | 26 828 |
| Franc suisse | 15 133 | 1 046 | 16 179 | 916 | 1 317 | 2 233 |
| Dollar de Taïwan | 14 734 | (1 293) | 13 441 | 0 | (3 773) | (3 773) |
| | \$ 149 441 | \$ (4 692) | \$ 144 749 | \$ 210 662 | \$ (101 251) | \$ 109 411 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Euro | \$ 76 096 | \$ (76 930) | \$ (834) | \$ 126 256 | \$ (132 486) | \$ (6 230) |
| Fonds Dynamic Bond Fund | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar canadien | \$ 2 247 | \$ (84 082) | \$ (81 835) | \$ 2 710 | \$ (624) | \$ 2 086 |
| Yen japonais | 154 | 88 908 | 89 062 | 221 727 | (186 589) | 35 138 |
| | \$ 2 401 | \$ 4 826 | \$ 7 227 | \$ 224 437 | \$ (187 213) | \$ 37 224 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Réal brésilien | € 0 | € 70 583 | € 70 583 | € 0 | € 114 243 | € 114 243 |
| Livre sterling britannique | 295 400 | (398 257) | (102 857) | 72 902 | (195 150) | (122 248) |
| Dollar canadien | 19 126 | (90 199) | (71 073) | 68 142 | 42 315 | 110 457 |
| Peso chilien | 0 | 78 216 | 78 216 | 0 | 119 441 | 119 441 |
| Peso colombien | 0 | 73 312 | 73 312 | 0 | 65 018 | 65 018 |
| Forint hongrois | 0 | 65 958 | 65 958 | 0 | 144 948 | 144 948 |
| Roupie indienne | 0 | 98 221 | 98 221 | 0 | 123 814 | 123 814 |
| Shekel israélien | 0 | (109 588) | (109 588) | 25 085 | (170 811) | (145 726) |
| Couronne norvégienne | 12 193 | 39 552 | 51 745 | 25 356 | 110 729 | 136 085 |
| Nuevo Sol péruvien | 0 | 73 633 | 73 633 | 0 | 73 740 | 73 740 |
| Dollar de Taïwan | 42 004 | (191 353) | (149 349) | 172 004 | (366 954) | (194 950) |
| Dollar américain | 2 059 425 | (897 289) | 1 162 136 | 1 313 859 | (1 521 877) | (208 018) |
| | € 2 428 148 | € (1 187 211) | € 1 240 937 | € 1 677 348 | € (1 460 544) | € 216 804 |

Fonds Emerging Local Bond Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|---------------------------------------|---------------------|------------|--------------|---------------------|------------|--------------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Réal brésilien | \$ 47 416 | \$ 308 936 | \$ 356 352 | \$ 72 605 | \$ 116 650 | \$ 189 255 |
| Peso chilien | 108 258 | (61 784) | 46 474 | 48 276 | (5 534) | 42 742 |
| Renminbi chinois (Chine continentale) | 151 215 | 110 209 | 261 424 | 111 344 | 54 864 | 166 208 |
| Peso colombien | 160 432 | 19 884 | 180 316 | 92 165 | (2 600) | 89 565 |
| Couronne tchèque | 124 618 | 43 798 | 168 416 | 56 636 | 47 780 | 104 416 |
| Euro | 79 847 | (180 286) | (100 439) | 65 535 | (36 905) | 28 630 |
| Forint hongrois | 64 408 | 67 181 | 131 589 | 61 026 | (734) | 60 292 |
| Roupie indonésienne | 275 641 | (35 844) | 239 797 | 166 739 | 39 786 | 206 525 |
| Ringgit malaisien | 244 416 | 50 578 | 294 994 | 176 652 | 11 634 | 188 286 |
| Peso mexicain | 245 488 | 66 863 | 312 351 | 144 527 | 33 144 | 177 671 |
| Nuevo Sol péruvien | 55 001 | 19 709 | 74 710 | 46 699 | (3 191) | 43 508 |
| Peso philippin | (175 483) | (2 913) | (178 396) | 855 | 447 | 1 302 |
| Zloty polonais | 14 575 | 191 428 | 206 003 | 8 441 | 107 423 | 115 864 |
| Leu roumain | 75 514 | 30 448 | 105 962 | 76 773 | (15 089) | 61 684 |
| Rand sud-africain | 370 121 | (114 894) | 255 227 | 257 451 | (84 444) | 173 007 |
| Baht thaïlandais | 240 767 | 28 346 | 269 113 | 80 943 | 110 257 | 191 200 |
| Livre turque | 8 487 | 126 238 | 134 725 | 0 | 1 326 | 1 326 |
| | \$ 2 090 721 | \$ 667 897 | \$ 2 758 618 | \$ 1 466 667 | \$ 374 814 | \$ 1 841 481 |

Fonds Emerging Local Bond ESG Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|---------------------|---------------------|------------|-----------|---------------------|------------|----------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Réal brésilien | \$ 429 | \$ 11 111 | \$ 11 540 | \$ 251 | \$ 361 | \$ 612 |
| Peso chilien | 4 290 | (2 034) | 2 256 | 140 | 54 | 194 |
| Peso colombien | 4 731 | (88) | 4 643 | 233 | (20) | 213 |
| Couronne tchèque | 6 641 | 1 176 | 7 817 | 453 | 128 | 581 |
| Euro | (123) | (4 617) | (4 740) | 37 | 66 | 103 |
| Forint hongrois | 4 201 | 1 364 | 5 565 | 260 | (13) | 247 |
| Roupie indonésienne | 7 998 | 1 862 | 9 860 | 671 | 4 | 675 |
| Ringgit malaisien | 6 112 | 6 041 | 12 153 | 588 | 159 | 747 |
| Peso mexicain | 8 666 | 1 982 | 10 648 | 545 | 96 | 641 |
| Nuevo Sol péruvien | 1 977 | 535 | 2 512 | 146 | 3 | 149 |
| Peso philippin | (10 143) | (19) | (10 162) | 0 | 3 | 3 |
| Zloty polonais | 8 460 | 2 152 | 10 612 | 371 | 168 | 539 |
| Leu roumain | 3 714 | 1 280 | 4 994 | 290 | (15) | 275 |
| Rand sud-africain | 12 163 | (3 386) | 8 777 | 823 | (230) | 593 |
| Baht thaïlandais | 8 172 | 1 121 | 9 293 | 283 | 346 | 629 |
| Livre turque | 11 | 4 209 | 4 220 | 0 | (20) | (20) |
| | \$ 67 299 | \$ 22 689 | \$ 89 988 | \$ 5 091 | \$ 1 090 | \$ 6 181 |

Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|---------------------------------------|---------------------|------------|------------|---------------------|------------|-----------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Réal brésilien | \$ 5 349 | \$ 20 716 | \$ 26 065 | \$ 5 017 | \$ 5 180 | \$ 10 197 |
| Livre sterling britannique | 1 681 | (12 906) | (11 225) | 2 581 | (1 942) | 639 |
| Peso chilien | 10 599 | (7 974) | 2 625 | 208 | 5 420 | 5 628 |
| Renminbi chinois (Chine continentale) | 19 | 4 544 | 4 563 | 377 | 8 175 | 8 552 |
| Peso colombien | 6 900 | 9 067 | 15 967 | 438 | 1 203 | 1 641 |
| Euro | 28 577 | (47 783) | (19 206) | 11 804 | (15 001) | (3 197) |
| Forint hongrois | 8 150 | 17 326 | 25 476 | 11 388 | (10 979) | 409 |
| Roupie indienne | 18 346 | 7 202 | 25 548 | 0 | 0 | 0 |
| Roupie indonésienne | 0 | 15 048 | 15 048 | 0 | 15 191 | 15 191 |
| Ringgit malaisien | 22 | 5 160 | 5 182 | (37) | 7 337 | 7 300 |
| Peso mexicain | 18 579 | 2 103 | 20 682 | 2 101 | 723 | 2 824 |
| Leu roumain | 571 | 5 092 | 5 663 | 0 | (53) | (53) |
| Dollar de Singapour | 3 | (7 658) | (7 655) | 105 | 165 | 270 |
| Rand sud-africain | 18 248 | (9 838) | 8 410 | 10 393 | (4 989) | 5 404 |
| Baht thaïlandais | 79 | 2 906 | 2 985 | 246 | 4 183 | 4 429 |
| Livre turque | 0 | 19 096 | 19 096 | 2 | (5 829) | (5 827) |
| | \$ 117 123 | \$ 22 101 | \$ 139 224 | \$ 44 623 | \$ 8 784 | \$ 53 407 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | | | | | | |
|--|-------------|-------------|------------|----------------------------|-------------|------------|--|
| Au 31 décembre 2023 | | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net | |
| Réal brésilien | \$ 154 | \$ 1 276 | \$ 1 430 | \$ 577 | \$ 558 | \$ 1 135 | |
| Renminbi chinois (Chine continentale) | 94 | 1 606 | 1 700 | 24 | 1 897 | 1 921 | |
| Peso colombien | 804 | (300) | 504 | 758 | (444) | 314 | |
| Couronne tchèque | 101 | 647 | 748 | 193 | 702 | 895 | |
| Euro | 710 | (1 439) | (729) | 582 | (306) | 276 | |
| Forint hongrois | 2 031 | (1 215) | 816 | 648 | (22) | 626 | |
| Roupie indienne | (1) | 1 864 | 1 863 | 0 | 1 657 | 1 657 | |
| Roupie indonésienne | 0 | 747 | 747 | 1 | 945 | 946 | |
| Ringgit malaisien | 985 | (22) | 963 | 76 | 926 | 1 002 | |
| Peso mexicain | 617 | 1 438 | 2 055 | 361 | 1 674 | 2 035 | |
| Zloty polonais | 439 | 811 | 1 250 | 82 | 1 074 | 1 156 | |
| Leu roumain | 19 | 361 | 380 | 0 | 425 | 425 | |
| Dollar de Singapour | 4 | 1 534 | 1 538 | 1 | 1 580 | 1 581 | |
| Rand sud-africain | 1 531 | (746) | 785 | 819 | (440) | 379 | |
| Won sud-coréen | 4 | 2 043 | 2 047 | 5 | 2 240 | 2 245 | |
| Dollar de Taïwan | 0 | 1 487 | 1 487 | 0 | 1 325 | 1 325 | |
| Baht thaïlandais | 2 | 930 | 932 | (1) | 1 084 | 1 083 | |
| Livre turque | 0 | 1 674 | 1 674 | 0 | 766 | 766 | |
| | \$ 7 494 | \$ 12 696 | \$ 20 190 | \$ 4 126 | \$ 15 641 | \$ 19 767 | |
| Fonds Euro Bond Fund | | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net | |
| Dollar américain | € 370 646 | € (188 216) | € 182 430 | € 271 900 | € (176 499) | € 95 401 | |
| Fonds Euro Credit Fund | | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net | |
| Dollar américain | € 53 596 | € (29 784) | € 23 812 | € 89 377 | € (81 174) | € 8 203 | |
| Fonds Euro Income Bond Fund | | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net | |
| Dollar américain | € 1 028 106 | € (402 089) | € 626 017 | € 292 182 | € (272 298) | € 19 884 | |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net | |
| Dollar américain | € 107 873 | € (32 196) | € 75 677 | € 9 930 | € (6 060) | € 3 870 | |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net | |
| Dollar américain | € 27 342 | € (12 915) | € 14 427 | € 26 301 | € (15 271) | € 11 030 | |
| Fonds Global Advantage Fund | | | | | | | |
| Au 31 décembre 2023 | | | | Au 31 décembre 2022 | | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net | |
| Dollar australien | \$ 16 478 | \$ 1 438 | \$ 17 916 | \$ 17 341 | \$ 2 048 | \$ 19 389 | |
| Réal brésilien | 83 | 10 466 | 10 549 | 2 687 | 5 312 | 7 999 | |
| Livre sterling britannique | 25 058 | (11 051) | 14 007 | 32 405 | (19 088) | 13 317 | |
| Dollar canadien | 5 346 | (3 704) | 1 642 | 2 065 | 6 250 | 8 315 | |
| Renminbi chinois (Chine continentale) | 251 | 32 792 | 33 043 | 443 | 35 354 | 35 797 | |
| Renminbi chinois (Offshore) | 0 | 2 669 | 2 669 | 2 | 9 188 | 9 190 | |
| Euro | 106 734 | (27 740) | 78 994 | 100 213 | (17 702) | 82 511 | |
| Roupie indienne | 2 924 | 16 429 | 19 353 | 2 953 | 11 479 | 14 432 | |
| Yen japonais | 38 301 | (8 871) | 29 430 | 13 430 | 17 993 | 31 423 | |
| Peso mexicain | 125 | 9 259 | 9 384 | 143 | 4 037 | 4 180 | |
| | \$ 195 300 | \$ 21 687 | \$ 216 987 | \$ 171 682 | \$ 54 871 | \$ 226 553 | |

Fonds Global Bond Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|-----------------------------|---------------------|--------------|------------|---------------------|--------------|------------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar australien | \$ 530 678 | \$ (200 364) | \$ 330 314 | \$ 493 730 | \$ (113 174) | \$ 380 556 |
| Renminbi chinois (Offshore) | 0 | (328 466) | (328 466) | 1 | (7 989) | (7 988) |
| | \$ 530 678 | \$ (528 830) | \$ 1 848 | \$ 493 731 | \$ (121 163) | \$ 372 568 |

Fonds Global Bond ESG Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|-----------------------------|---------------------|-------------|-------------|---------------------|------------|----------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Renminbi chinois (Offshore) | \$ 0 | \$ (86 753) | \$ (86 753) | \$ 0 | \$ 2 180 | \$ 2 180 |

Fonds Global Bond Ex-US Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|---------------------------------------|---------------------|-------------|------------|---------------------|-------------|-----------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar australien | \$ 34 294 | \$ (15 133) | \$ 19 161 | \$ 34 822 | \$ (13 053) | \$ 21 769 |
| Renminbi chinois (Chine continentale) | 32 483 | 0 | 32 483 | 15 260 | 0 | 15 260 |
| Renminbi chinois (Offshore) | 0 | (57 267) | (57 267) | 0 | (21 272) | (21 272) |
| | \$ 66 777 | \$ (72 400) | \$ (5 623) | \$ 50 082 | \$ (34 325) | \$ 15 757 |

Fonds Income Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|-----------------------------|---------------------|----------------|----------------|---------------------|----------------|--------------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Réal brésilien | \$ 648 | \$ 2 606 334 | \$ 2 606 982 | \$ (7 405) | \$ 977 922 | \$ 970 517 |
| Dollar canadien | 317 982 | (2 673 187) | (2 355 205) | 35 234 | (39 351) | (4 117) |
| Renminbi chinois (Offshore) | 0 | (1 951 254) | (1 951 254) | 0 | (3 531) | (3 531) |
| Yen japonais | 2 532 381 | (971 099) | 1 561 282 | 2 979 968 | (1 651 362) | 1 328 606 |
| Dollar de Taïwan | 0 | (1 497 865) | (1 497 865) | 0 | (313 972) | (313 972) |
| | \$ 2 851 011 | \$ (4 487 071) | \$ (1 636 060) | \$ 3 007 797 | \$ (1 030 294) | \$ 1 977 503 |

Fonds Income Fund II

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|-------------------|---------------------|------------|------------|---------------------|------------|----------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar australien | \$ 11 | \$ (2 852) | \$ (2 841) | \$ 0 | \$ 1 031 | \$ 1 031 |
| Réal brésilien | 0 | 3 316 | 3 316 | 176 | 583 | 759 |
| | \$ 11 | \$ 464 | \$ 475 | \$ 176 | \$ 1 614 | \$ 1 790 |

Fonds Inflation Multi-Asset Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|-----------------|---------------------|------------|-----------|---------------------|------------|-----------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Roupie indienne | \$ 0 | \$ 5 340 | \$ 5 340 | \$ 0 | \$ 5 063 | \$ 5 063 |
| Peso mexicain | 0 | 5 582 | 5 582 | 0 | 5 993 | 5 993 |
| | \$ 0 | \$ 10 922 | \$ 10 922 | \$ 0 | \$ 11 056 | \$ 11 056 |

Fonds Low Duration Income Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|-----------------|---------------------|--------------|------------|---------------------|------------|------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar canadien | \$ 373 193 | \$ (237 305) | \$ 135 888 | \$ 1 | \$ (1) | \$ 0 |

Fonds Low Duration Opportunities Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|------|---------------------|--------------|-------------|---------------------|--------------|-------------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Euro | \$ 187 178 | \$ (201 645) | \$ (14 467) | \$ 197 537 | \$ (226 587) | \$ (29 050) |

Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
|-----------------------------|---------------------|------------|----------|---------------------|------------|------|
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar canadien | \$ 151 | \$ (430) | \$ (279) | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 |
| Renminbi chinois (Offshore) | 0 | (231) | (231) | 0 | 0 | 0 |
| | \$ 151 | \$ (661) | \$ (510) | \$ 2 | \$ 0 | \$ 2 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Fonds Strategic Income Fund | | | | | |
|-------------------|-----------------------------|-------------|-----------|---------------------|------------|-----------|
| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar australien | \$ 2 444 | \$ (850) | \$ 1 594 | \$ 5 676 | \$ 6 403 | \$ 12 079 |
| Réal brésilien | 3 988 | 12 325 | 16 313 | 2 987 | 6 021 | 9 008 |
| Euro | 45 625 | (30 235) | 15 390 | 15 965 | (9 432) | 6 533 |
| Yen japonais | 6 598 | \$ 6 604 | 13 202 | 6 770 | 7 884 | 14 654 |
| | \$ 58 655 | \$ (12 156) | \$ 46 499 | \$ 31 398 | \$ 10 876 | \$ 42 274 |

| | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | | | | |
|-----------------------------|--|------------|-----------|---------------------|-------------|-----------|
| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Réal brésilien | \$ 2 827 | \$ 11 051 | \$ 13 878 | \$ 264 | \$ 13 022 | \$ 13 286 |
| Livre sterling britannique | (52) | 15 640 | 15 588 | 123 | 5 593 | 5 716 |
| Dollar canadien | 338 | 21 931 | 22 269 | 16 561 | (23 692) | (7 131) |
| Peso chilien | (2 719) | (4 767) | (7 486) | (737) | 14 132 | 13 395 |
| Renminbi chinois (Offshore) | 0 | 5 842 | 5 842 | 0 | (2 252) | (2 252) |
| Peso colombien | (2 626) | 10 442 | 7 816 | 25 | (5 782) | (5 757) |
| Euro | 1 747 | 3 266 | 5 013 | 398 | 15 | 413 |
| Forint hongrois | 6 682 | (2 902) | 3 780 | 564 | 10 036 | 10 600 |
| Roupie indienne | (10) | (655) | (665) | (1 228) | (31 304) | (32 532) |
| Roupie indonésienne | 0 | (7 857) | (7 857) | 0 | (20 219) | (20 219) |
| Shekel israélien | (736) | 2 361 | 1 625 | 8 144 | (35 304) | (27 160) |
| Ringgit malaisien | (508) | (5 482) | (5 990) | 348 | 3 776 | 4 124 |
| Peso mexicain | (186) | 8 156 | 7 970 | (52) | 7 371 | 7 319 |
| Dollar néo-zélandais | 0 | 11 777 | 11 777 | 0 | 10 948 | 10 948 |
| Nuevo Sol péruvien | 0 | 6 887 | 6 887 | 0 | 15 806 | 15 806 |
| Peso philippin | 0 | 7 253 | 7 253 | 0 | 5 033 | 5 033 |
| Leu roumain | 0 | (29) | (29) | 0 | 17 909 | 17 909 |
| Dollar de Singapour | 44 | (3 051) | (3 007) | (482) | 9 478 | 8 996 |
| Couronne suédoise | 185 | 5 038 | 5 223 | 98 | 852 | 950 |
| Franc suisse | 0 | 12 005 | 12 005 | 45 | 9 471 | 9 516 |
| Dollar de Taïwan | 3 | (14 078) | (14 075) | (707) | 0 | (707) |
| Baht thaïlandais | 331 | (7 195) | (6 864) | 116 | (18 208) | (18 092) |
| | \$ 5 320 | \$ 75 633 | \$ 80 953 | \$ 23 480 | \$ (13 319) | \$ 10 161 |

| | Fonds UK Corporate Bond Fund | | | | | |
|------------------|------------------------------|------------|----------|---------------------|------------|---------|
| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar américain | £ 18 144 | £ (6 033) | £ 12 111 | £ 14 318 | £ (14 729) | £ (411) |

| | Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | | | | |
|------------------|--|------------|----------|---------------------|------------|-------|
| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | |
| | Total | Couverture | Net | Total | Couverture | Net |
| Dollar américain | £ 20 341 | £ (1 951) | £ 18 390 | £ 22 661 | £ (21 868) | £ 793 |

(c) Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est le risque que les titres à revenu fixe perdent de la valeur en raison de fluctuations des taux d'intérêt. À mesure que les taux d'intérêt nominaux augmentent, la valeur de certains titres à revenu fixe détenus par les Fonds est susceptible de diminuer. On peut décrire un taux d'intérêt nominal comme la somme d'un taux d'intérêt réel et du taux d'inflation prévu. Les titres à revenu fixe dotés de longues durations tendent à être plus sensibles aux fluctuations des taux d'intérêt, ce qui en fait des titres plus volatils que ceux assortis d'une durée plus courte. La durée sert principalement de mesure de la sensibilité de la variation des prix de marché des titres à revenu fixe en fonction des taux d'intérêt (c'est-à-dire le rendement).

Tous les Fonds investis principalement dans des instruments à revenu fixe sont donc exposés aux risques associés aux effets des fluctuations des taux d'intérêt en vigueur sur le marché sur leur situation financière et leurs flux de trésorerie. Ces investissements sont présentés dans le Tableau des investissements. Les liquidités et quasi-liquidités excédentaires sont investies à des taux d'intérêt du marché à court terme.

La sensibilité de l'exposition de la Société au risque de taux d'intérêt est incluse dans les calculs de la VaR globale divulgués dans la Note 16 (a).

(d) Risque de liquidité

L'exposition d'un Fonds au risque de liquidité est principalement affectée par le rachat d'actions. Les porteurs d'actions de participation peuvent présenter au rachat tout ou partie de leurs actions en circulation conformément au Prospectus. Les actions remboursables sont rachetées à la demande des actionnaires et incluses dans le Bilan. Les actifs du Fonds se composent essentiellement de

titres facilement réalisables, qu'il est possible de vendre rapidement pour satisfaire aux demandes de rachat des actionnaires, conformément au Prospectus. Le risque de liquidité survient lorsque des investissements particuliers sont difficiles à acheter ou à vendre. En outre, les titres illiquides peuvent être plus difficiles à valoriser, notamment sur des marchés volatils. Les investissements d'un Fonds dans des titres illiquides peuvent réduire ses rendements, car il peut être dans l'incapacité de vendre les titres illiquides à un moment ou un prix avantageux. Les Fonds dont les stratégies d'investissement principales impliquent des titres étrangers, des instruments financiers dérivés ou des titres assortis d'un risque de marché et/ou de crédit important ont tendance à avoir la plus grande exposition au risque de liquidité.

Par ailleurs, le marché de certains titres peut devenir illiquide dans des conditions économiques ou de marché défavorables, indépendamment de toute évolution défavorable de la situation d'un émetteur en particulier. Le cas échéant, un Fonds, en raison des restrictions imposées sur les investissements dans des titres illiquides et de la difficulté d'acheter et de vendre ces titres ou ces instruments, peut ne pas être en mesure d'atteindre le niveau d'exposition souhaité à un secteur donné. Dans la mesure où les principales stratégies d'investissement d'un Fonds impliquent des titres de sociétés possédant des capitalisations boursières plus petites, des titres étrangers, des secteurs illiquides de titres à revenu fixe ou des titres présentant un risque de marché et/ou de crédit important, le Fonds présentera également l'exposition au risque de liquidité la plus importante. De plus, les titres à revenu fixe assortis de durations plus longues jusqu'à l'échéance comportent un risque de liquidité plus élevé que les titres à revenu fixe qui possèdent des durations plus courtes.

Enfin, le risque de liquidité désigne également le risque de recevoir un nombre de demandes de rachat exceptionnellement élevé ou d'autres conditions anormales du marché susceptibles d'empêcher un Fonds d'honorer pleinement les demandes de rachat dans le délai imparti. Afin de pouvoir honorer ces demandes de rachat, un Fonds peut être contraint de vendre des titres à des prix réduits ou à des conditions défavorables, ce qui entraînerait une diminution de sa valeur. Il se peut également que d'autres opérateurs de marché tentent de liquider leurs titres à revenu fixe en même temps qu'un Fonds, ce qui entraînerait une augmentation de l'offre sur le marché et aggraverait le risque de liquidité et la pression à la baisse sur les prix.

Pour tous les Fonds, la Société est en droit de limiter le nombre d'actions d'un Fonds rachetées un Jour de négociation à 10 % du nombre total d'actions de ce Fonds en circulation. Dans ce cas, la Société réduira au prorata toute demande de rachat ce Jour de négociation et traitera les demandes de rachat comme si elles avaient été reçues chaque Jour de négociation suivant jusqu'à ce que toutes les actions auxquelles la demande initiale a été liée aient été rachetées.

Les Statuts de la Société contiennent des dispositions spéciales lorsqu'une demande de rachat reçue d'un actionnaire entraînerait le rachat par la Société de plus de 5 % de la Valeur Nette d'Inventaire des Actions d'un Fonds lors d'un Jour de négociation. Le cas échéant, la Société, à sa seule discrétion (sauf indication contraire dans le Supplément du Fonds concerné), peut honorer la demande de rachat par le transfert en numéraire (en nature) à l'actionnaire des actifs du Fonds concerné possédant une valeur égale au prix de rachat des actions rachetées comme si le produit du rachat était payé en numéraire moins les frais de rachat et les autres frais du transfert, à condition qu'une telle distribution ne porte pas atteinte aux intérêts des autres actionnaires de ce Fonds. Lorsque l'actionnaire qui demande un tel rachat est informé de l'intention de la Société de choisir de répondre favorablement à la demande de rachat en procédant à ladite distribution d'actifs, ledit actionnaire peut exiger de la Société de vendre les actifs et de lui en verser le produit plutôt que de les transférer, une opération dont le coût sera à sa charge.

Pour atténuer les effets de la dilution, les Administrateurs peuvent, à leur discrétion, procéder à un ajustement du swing price de la VNI par action.

Les éléments de passif à court terme connus des Fonds sont identifiés dans le Bilan et la majorité de ces passifs sont exigibles à moins de trois mois, à l'exception des passifs liés aux instruments financiers dérivés et aux titres vendus à découvert. Les dates d'échéance contractuelles les plus précoces pour les passifs liés aux instruments financiers dérivés sont indiquées dans le Tableau des investissements.

Les instruments financiers dérivés sont constitués de la juste valeur de contrats de change à terme, de contrats à terme standardisés, de contrats d'option et de contrats de swap à la fin de l'exercice. Les instruments financiers dérivés sont des actifs et des passifs financiers détenus pour négociation, et sont principalement acquis à des fins de revente à court terme. Dans la mesure où les instruments ne devraient pas être détenus jusqu'à échéance ou résiliation, la juste valeur actuelle représente le flux de trésorerie estimé susceptible d'être requis pour solder les positions. Les flux de trésorerie futurs des Fonds et les passifs réalisés peuvent différer des passifs à court terme en fonction de l'évolution des conditions de marché.

Les Conseillers en investissement gèrent le risque de liquidité en surveillant les portefeuilles et investissements jugés illiquides ou non cessibles immédiatement ou facilement, afin de garantir qu'il y ait suffisamment d'actifs liquides pour couvrir l'encours des passifs des Fonds.

Certains Fonds peuvent avoir une base d'actionnaires concentrée lorsque de grands actionnaires institutionnels détiennent une part importante de l'actif net d'un Fonds. Cela expose les autres actionnaires du Fonds à certains risques. Ces risques comprennent le risque qu'une grande partie des actifs d'un Fonds puisse être rachetée n'importe quel jour, ce qui pourrait avoir un impact sur la viabilité globale du Fonds ou sur la capacité des autres actionnaires, qui n'ont pas soumis de demandes de rachat ce jour-là, de procéder au rachat auprès du Fonds, par exemple lorsqu'il peut s'avérer nécessaire d'imposer un seuil de rachat. Les Fonds ci-dessous sont exposés à un risque de concentration important, car ils ont des actionnaires qui détiennent plus de 20 % de l'Actif net du Fonds. Une telle concentration des intérêts des actionnaires pourrait avoir un effet important sur le Fonds si cet actionnaire demande le retrait de montants importants de capital. Les montants en pourcentage de participation détenus par le Groupe Allianz, les Fonds de la Société, les Fonds affiliés à la Société et les employés des Conseillers en investissement ne sont pas indiqués ci-dessous, car ils sont communiqués séparément à la Note 14.

| Nom du Fonds | 31 décembre 2023 | | 31 décembre 2022 | |
|--|----------------------|--------------------|----------------------|--------------------|
| | Nom de l'actionnaire | Participation en % | Nom de l'actionnaire | Participation en % |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Actionnaire T | S/O | Actionnaire T | 30,91 |
| Fonds Commodity Real Return Fund | Actionnaire A | S/O | Actionnaire A | 21,10 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Actionnaire B | 24,00 | Actionnaire B | 22,79 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Actionnaire F | 40,05 | Actionnaire F | 34,98 |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | Actionnaire V | 91,84 | Actionnaire V | S/O |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | Actionnaire O | 62,78 | Actionnaire O | 54,14 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Actionnaire R | 22,69 | Actionnaire R | 31,08 |
| Fonds Euro Bond Fund | Actionnaire J | S/O | Actionnaire J | 22,29 |
| Fonds Euro Credit Fund | Actionnaire K | 26,31 | Actionnaire K | 20,35 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | Actionnaire J | 83,92 | Actionnaire J | S/O |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | Actionnaire M | S/O | Actionnaire M | 36,92 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | Actionnaire L | S/O | Actionnaire L | 20,79 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | Actionnaire W | S/O | Actionnaire W | 24,59 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Actionnaire D | 29,10 | Actionnaire D | 27,37 |
| Fonds Global Advantage Fund | Actionnaire N | 29,85 | Actionnaire N | 29,19 |
| Fonds Global Bond ESG Fund | Actionnaire P | 21,43 | Actionnaire P | S/O |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Actionnaire Q | 20,53 | Actionnaire Q | S/O |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Actionnaire S | S/O | Actionnaire S | 20,85 |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | Actionnaire E | 37,92 | Actionnaire E | S/O |
| Fonds Income Fund II | Actionnaire U | 52,36 | Actionnaire U | 46,97 |
| Fonds Income Fund II | Actionnaire X | 24,05 | Actionnaire X | S/O |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Actionnaire Y | 34,30 | Actionnaire Y | 46,86 |
| Fonds Low Duration Income Fund | Actionnaire Y | 31,49 | Actionnaire Y | 54,34 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Actionnaire AA | S/O | Actionnaire AA | 34,76 |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | Actionnaire C | 23,23 | Actionnaire C | S/O |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | Actionnaire G | 24,75 | Actionnaire G | S/O |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | Actionnaire H | 48,26 | Actionnaire H | 44,00 |

(e) Risques de crédit et de contrepartie

Les Fonds seront exposés au risque de crédit des parties avec lesquelles ils réalisent des transactions et supporteront également le risque de défaut de règlement. Les Fonds négocient avec des contreparties qui, à l'heure actuelle, ont une notation minimum de BBB/Baa2. Les Fonds minimisent les concentrations du risque de crédit en effectuant des transactions avec un grand nombre de clients et de contreparties sur des bourses de valeurs reconnues et réputées, le cas échéant. Les opérations sur instruments financiers dérivés hors cote sont exposées au risque d'inexécution des obligations contractuelles d'une contrepartie à la transaction vis-à-vis de l'autre partie, car un grand nombre des protections dont bénéficient les opérations sur instruments financiers dérivés compensées ne sont pas accessibles aux opérations sur instruments financiers dérivés hors cote. En ce qui concerne les instruments financiers dérivés négociés sur des marchés boursiers ou dans des chambres de compensation, le principal risque de crédit est la solvabilité du courtier chargé de la compensation, de la bourse ou de la chambre de compensation elle-même du Fonds. Les Fonds peuvent perdre de l'argent si l'émetteur ou le garant d'un titre à revenu fixe, ou la contrepartie à un contrat portant sur des instruments financiers dérivés, un contrat de mise en pension ou un prêt de titres en portefeuille, n'est pas en mesure ou refuse de procéder aux paiements de principal et/ou d'intérêts en temps voulu, ou d'honorer autrement ses obligations. Les titres et les instruments financiers dérivés sont soumis à différents niveaux de risque de crédit, qui se reflètent souvent dans les cotes de solvabilité (notation).

De la même manière, les Fonds peuvent être exposés au risque de contrepartie ou risque qu'une partie à une transaction avec un Fonds n'exécute pas ou n'honore pas une obligation due au Fonds. PIMCO, en sa qualité de Conseiller en investissement, minimise le risque de contrepartie auquel est exposé le Fonds de diverses manières. Avant de conclure des transactions avec une nouvelle contrepartie, le Comité du risque de contrepartie de PIMCO procède à un examen complet de la solvabilité de cette contrepartie et doit impérativement approuver le recours à cette contrepartie. Par ailleurs, conformément aux conditions du contrat sous-jacent, dans la mesure où les montants impayés dus à un Fonds dépassent un seuil prédéterminé, la contrepartie devra avancer une garantie au Fonds sous la forme de liquidités ou de titres d'une valeur égale au montant impayé dû audit Fonds. Les Fonds peuvent investir ces garanties dans des titres ou autres instruments et paieront normalement à la contrepartie un intérêt sur la garantie reçue. Si le montant impayé dû à chaque Fonds diminue par la suite, le Fonds devra rendre à la contrepartie tout ou une partie de la garantie qui a été précédemment avancée.

Toutes les transactions sur les valeurs inscrites à la cote sont réglées/payées à la livraison en utilisant des contreparties agréées. Le risque de défaut est considéré comme minime, dès lors que la livraison des titres vendus est uniquement effectuée à réception du règlement par les Fonds. Le versement est effectué sur une acquisition une fois que les titres ont été livrés par la contrepartie. L'échange ne peut avoir lieu si l'une des parties ne respecte pas son engagement.

Contrats cadres de compensation Certains Fonds peuvent faire l'objet de diverses conventions de compensation avec certaines contreparties (« Contrats cadres »). Les Contrats cadres régissent les modalités de certaines transactions et réduisent le risque de contrepartie associé aux transactions en définissant des mécanismes de protection du crédit et en prévoyant une normalisation qui améliore la certitude juridique. Chaque type de Contrat cadre régit certains types de transactions. En fonction de leur type, les transactions peuvent être effectuées à partir de différentes entités juridiques ou affiliées à une organisation donnée, ce qui rend nécessaire la conclusion de plusieurs contrats avec la même contrepartie. Comme les Contrats cadres sont propres à des opérations particulières de différents types d'actifs, ils permettent aux Fonds de liquider et de réduire son exposition totale à une contrepartie en cas de défaillance pour toutes les transactions régies par un même Contrat cadre avec cette contrepartie. Pour les besoins de la présentation de l'information financière, le Bilan présente généralement les actifs et passifs dérivés sur une base brute, qui reflète l'intégralité des risques et expositions avant la compensation.

Les Contrats cadres peuvent également permettre de limiter le risque de contrepartie en spécifiant les accords de garanties données à des niveaux d'exposition préétablis. En vertu des Contrats cadres, la garantie est

systématiquement transférée si l'exposition totale nette à certaines transactions (nette des garanties existantes déjà en place) régies par le Contrat cadre concerné avec une contrepartie d'un compte donné dépasse un seuil spécifié, qui varie généralement de zéro à 250 000 \$ (ou toute autre devise applicable) en fonction de la contrepartie et du type de Contrat cadre. À l'heure actuelle, les bons du Trésor américain et les liquidités en dollars américains sont généralement les formes de garanties privilégiées, bien que d'autres formes de titres bien notés et facilement négociables soient également autorisées en fonction du Contrat cadre ou son annexe relative aux garanties. Des titres et des espèces nantis en garantie sont inscrits à l'actif du Bilan en tant que composant des Actifs financiers à leur juste valeur par résultat (valeurs mobilières) ou Dépôts auprès de contrepartie (espèces). Les garanties en espèces reçues ne sont pas normalement gardées sur un compte distinct et sont donc inscrits au passif du Bilan en tant que Dépôts des contreparties. La juste valeur de tous titres reçus en tant que garantie n'est pas comptabilisée comme composant de la VNI. L'exposition globale des Fonds au risque de contrepartie peut varier fortement sur une courte période, car elle subit l'impact de chaque transaction qui relève du Contrat cadre.

Les Contrats cadres de mise en pension et les Contrats cadres globaux de mise en pension (individuellement et collectivement les « Contrats cadres de mise en pension ») régissent les transactions de mise en pension, de prise en pension et de financement par vente et rachat dos-à-dos entre les Fonds et les contreparties choisies. Les Contrats cadres de mise en pension comportent des dispositions relatives, entre autres, à la création, aux paiements de revenus, aux événements de défaillance et à la maintenance d'une garantie. La juste valeur des transactions relevant du Contrat cadre de mise en pension, les garanties nanties ou reçues et l'exposition nette par contrepartie en fin d'exercice sont présentées dans les Notes relatives au Tableau des investissements.

Les Contrats cadres de transactions à terme (« Contrats cadres de transactions à terme ») régissent certaines transactions de règlement à terme, telles que les titres TBA, les transactions à livraison différée ou par vente et rachat dos-à-dos par et entre les Fonds et certaines contreparties. Les Contrats cadres de transactions à terme comportent des dispositions relatives, entre autres, à la création et la confirmation, au paiement et au transfert, aux cas de défaillance, à la résiliation et à la maintenance d'une garantie. La juste valeur des transactions à terme, les garanties nanties ou reçues et l'exposition nette par contrepartie en fin d'exercice sont présentées dans les Notes relatives au Tableau des investissements.

Les Contrats cadres et Annexes de soutien au crédit de l'Association internationale des Swaps et Dérivés (International Swaps and Derivatives Association, Inc.) (« Contrats cadres de l'ISDA ») régissent les transactions bilatérales sur instruments financiers dérivés hors cote conclus par les Fonds et certaines contreparties. Les Contrats cadres de l'ISDA comportent des dispositions relatives aux obligations d'ordre général, aux déclarations, contrats, garanties et cas de défaillance ou résiliation. Parmi les causes de rupture, citons les conditions qui donnent droit aux contreparties à une rupture anticipée et imposent de régler toutes les transactions en cours aux termes du Contrat cadre de l'ISDA applicable. Toute décision de clôture anticipée peut avoir une incidence importante sur les états financiers. Dans des circonstances limitées, le Contrat cadre de l'ISDA peut contenir des dispositions supplémentaires qui offrent une protection vis-à-vis de la contrepartie allant au-delà de la couverture de l'exposition quotidienne existante si la qualité de crédit de la contrepartie s'est détériorée en deçà d'un niveau préétabli. Ces montants, le cas échéant, peuvent être (ou, si la loi l'exige, seront) séparés auprès d'un dépositaire tiers. La juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote, les garanties nanties ou reçues et l'exposition nette par contrepartie en fin d'exercice sont présentées dans les Notes relatives au Tableau des investissements. Les Conseillers en investissement procèdent à une recherche et à une analyse approfondies pour déterminer et quantifier le risque de crédit au sein des Fonds. Le risque de crédit au sein des Fonds est examiné fréquemment par les Conseillers en investissement pour générer des résultats à travers des placements effectués ou évités. Les titres sont soumis à différents niveaux de risque de crédit, qui se reflètent souvent dans des cotes de solvabilité (notation). Les tableaux ci-dessous résument la composition de la notation de crédit pour chacun des actifs nets du Fonds.

| | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | |
|--------------------------|---|------------------|--|------------------|--|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 39 % | 34 % | 73 % | 70 % | 85 % | 93 % |
| « Non-Investment Grade » | 61 % | 66 % | 27 % | 30 % | 15 % | 7 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | Fonds PIMCO Climate Bond Fund | | Fonds Commodity Real Return Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 79 % | 76 % | 95 % | 91 % | 99 % | 99 % |
| « Non-Investment Grade » | 21 % | 24 % | 5 % | 9 % | 1 % | 1 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | Fonds Diversified Income Fund | | Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 70 % | 68 % | 75 % | 79 % | 73 % | 71 % |
| « Non-Investment Grade » | 30 % | 32 % | 25 % | 21 % | 27 % | 29 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds Diversified Income ESG Fund | | Fonds Dynamic Bond Fund | | Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 67 % | 69 % | 86 % | 87 % | 99 % | 96 % |
| « Non-Investment Grade » | 33 % | 31 % | 14 % | 13 % | 1 % | 4 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds Emerging Local Bond Fund | | Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | | Fonds Emerging Markets Bond Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 78 % | 75 % | 85 % | 87 % | 69 % | 67 % |
| « Non-Investment Grade » | 22 % | 25 % | 15 % | 13 % | 31 % | 33 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | | Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 66 % | 66 % | 74 % | 75 % | 77 % | 84 % |
| « Non-Investment Grade » | 34 % | 34 % | 26 % | 25 % | 23 % | 16 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | Fonds PIMCO ESG Income Fund | | Fonds Euro Bond Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 84 % | 83 % | 88 % | 88 % | 97 % | 97 % |
| « Non-Investment Grade » | 16 % | 17 % | 12 % | 12 % | 3 % | 3 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds Euro Credit Fund | | Fonds Euro Income Bond Fund | | Fonds Euro Long Average Duration Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 99 % | 97 % | 92 % | 82 % | 100 % | 100 % |
| « Non-Investment Grade » | 1 % | 3 % | 8 % | 18 % | 0 % | 0 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds Euro Short-Term Fund | | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 100 % | 97 % | 47 % | 44 % | 97 % | 95 % |
| « Non-Investment Grade » | 0 % | 3 % | 53 % | 56 % | 3 % | 5 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| | Fonds Global Advantage Fund | | Fonds Global Bond Fund | | Fonds Global Bond ESG Fund | |
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| « Investment Grade » | 94 % | 90 % | 97 % | 96 % | 98 % | 97 % |
| « Non-Investment Grade » | 6 % | 10 % | 3 % | 4 % | 2 % | 3 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Fonds Global Bond Ex-US Fund | | Fonds Global High Yield Bond Fund | | Fonds Global Investment Grade Credit Fund | |
|--------------------------|------------------------------|------------------|-----------------------------------|------------------|---|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 96 % | 93 % | 17 % | 22 % | 94 % |
| « Non-Investment Grade » | 4 % | 7 % | 83 % | 78 % | 6 % | 10 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | Fonds Global Low Duration Real Return Fund | | Fonds Global Real Return Fund | |
|--------------------------|---|------------------|--|------------------|-------------------------------|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 97 % | 94 % | 100 % | 100 % | 99 % |
| « Non-Investment Grade » | 3 % | 6 % | 0 % | 0 % | 1 % | 1 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Fonds Income Fund | | Fonds Income Fund II | | Fonds Inflation Multi-Asset Fund | |
|--------------------------|----------------------|------------------|----------------------|------------------|----------------------------------|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 86 % | 77 % | 82 % | 70 % | 96 % |
| « Non-Investment Grade » | 14 % | 23 % | 18 % | 30 % | 4 % | 3 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Fonds Low Average Duration Fund | | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | Fonds Low Duration Income Fund | |
|--------------------------|---------------------------------|------------------|--|------------------|--------------------------------|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 97 % | 99 % | 96 % | 93 % | 89 % |
| « Non-Investment Grade » | 3 % | 1 % | 4 % | 7 % | 11 % | 20 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Fonds Low Duration Opportunities Fund | | Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | | Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | |
|--------------------------|---------------------------------------|------------------|---|------------------|--|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 84 % | 87 % | 97 % | 97 % | 100 % |
| « Non-Investment Grade » | 16 % | 13 % | 3 % | 3 % | 0 % | 0 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Fonds Mortgage Opportunities Fund | | Fonds StocksPLUS™ Fund | | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | |
|--------------------------|-----------------------------------|------------------|------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 87 % | 71 % | 95 % | 85 % | 95 % |
| « Non-Investment Grade » | 13 % | 29 % | 5 % | 15 % | 5 % | 6 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Fonds Strategic Income Fund | | Fonds Total Return Bond Fund | | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | |
|--------------------------|-----------------------------|------------------|------------------------------|------------------|--|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 81 % | 76 % | 96 % | 96 % | 94 % |
| « Non-Investment Grade » | 19 % | 24 % | 4 % | 4 % | 6 % | 5 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Fonds UK Corporate Bond Fund | | Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | Fonds US High Yield Bond Fund | |
|--------------------------|------------------------------|------------------|--|------------------|-------------------------------|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 98 % | 98 % | 98 % | 97 % | 14 % |
| « Non-Investment Grade » | 2 % | 2 % | 2 % | 3 % | 86 % | 80 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | | Fonds US Short-Term Fund | |
|--------------------------|---|------------------|--------------------------|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 |
| | « Investment Grade » | 96 % | 95 % | 100 % |
| « Non-Investment Grade » | 4 % | 5 % | 0 % | 1 % |
| Sans notation | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

Quasiment toutes les valeurs mobilières de la Société au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 sont détenues en fiducie par State Street Custodial Services (Ireland) Limited (le « Dépositaire »). Ces actifs sont détenus sur des comptes séparés pour chaque Fonds (conformément au Règlement OPCVM de la Banque centrale), ce qui réduit le risque de crédit lié à la détention des actifs à des fins de garde. Toutefois, la Société reste exposée au risque de crédit de l'institution de crédit qui détient ses dépôts.

La notation de crédit à long terme de State Street Corporation, la société mère ultime du Dépositaire, au 31 décembre 2023 était AA- (31 décembre 2022 : AA-) telle qu'émise par l'agence de notation Fitch.

Les transactions exécutées par l'intermédiaire d'un courtier qui est une Personne liée du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation, du Dépositaire et des Administrateurs de la Société étaient les suivantes pour les exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022 :

| Fonds | 31 décembre 2023 | | 31 décembre 2022 | |
|---|--|-------------------------------------|--|-------------------------------------|
| | Total des achats et des ventes (en milliers) | % du Total des achats et des ventes | Total des achats et des ventes (en milliers) | % du Total des achats et des ventes |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | \$ 9 568 971 | 28,83 | \$ 22 258 882 | 32,25 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 468 546 | 16,12 | 730 951 | 15,06 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 1 990 170 | 6,84 | S/O | S/O |
| Fonds Commodity Real Return Fund | 822 266 | 1,92 | 3 040 615 | 4,33 |
| Fonds Diversified Income Fund | 17 415 773 | 2,97 | 17 399 378 | 4,21 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | 1 941 990 | 2,19 | 1 659 744 | 2,12 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 1 720 658 | 4,79 | 3 169 131 | 7,60 |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 90 540 | 3,47 | 74 306 | 4,64 |
| Fonds Global Bond Fund | 10 278 565 | 1,54 | 9 557 901 | 1,81 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 1 236 160 | 3,56 | 4 538 756 | 6,31 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 7 383 647 | 2,15 | 3 450 967 | 2,04 |
| Fonds Global Real Return Fund | 11 655 391 | 10,87 | 1 300 718 | 1,03 |
| Fonds Income Fund | 269 554 565 | 8,92 | 349 874 783 | 11,02 |
| Fonds Income Fund II | 11 085 | 0,77 | 644 | 0,07 |
| Fonds Low Average Duration Fund | 8 790 073 | 18,73 | 2 519 168 | 3,60 |
| Fonds Total Return Bond Fund | 2 507 856 | 2,35 | 9 037 904 | 5,40 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | 1 581 144 | 14,46 | 5 136 959 | 14,37 |

Aucune commission n'a été prélevée sur les transactions du tableau ci-dessus pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 31 décembre 2022.

Les actions détenues dans des Fonds agréés par la SFC par les Administrateurs de la Société pour les exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022 sont détaillées dans la Note 14. Les commissions versées aux Administrateurs de la Société pour les exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022 sont détaillées dans la Note 13.

La valeur des actions en circulation détenues par des Personnes liées du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation au-delà de 20 % de l'Actif net des Fonds agréés par la SFC au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 est détaillée dans la Note 14. Les commissions versées au Gestionnaire, aux Conseillers en investissement et/ou aux Conseillers en investissement par délégation sont détaillées dans la Note 13 et dans le Compte de résultat.

Les Administrateurs et Dirigeants du Dépositaire ne détenaient d'actions dans aucun des Fonds agréés par la SFC pour les exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022. Comme indiqué à la Note 13, les commissions et frais du Dépositaire sont payés par le Gestionnaire à partir des Frais de gestion ou par les

17. TRANSACTIONS AVEC DES PERSONNES LIÉES POUR LES FONDS DISTRIBUÉS À HONG KONG

Les personnes liées du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation, du Dépositaire et des Administrateurs de la Société sont celles définies dans le Code relatif aux SICAV et aux Fonds communs de placement de la Commission des opérations sur titres et contrats à terme standardisés de Hong Kong (le « Code de la SFC »). Toutes les transactions conclues au cours de l'exercice entre les Fonds agréés par la SFC (« Fonds agréés par la SFC »), comme indiqué dans la section des caractéristiques générales du rapport annuel, et le Gestionnaire, les Conseillers en investissement et/ou les Conseillers en investissement par délégation, le Dépositaire et les Administrateurs de la Société et leurs Personnes liées respectives ont été exécutées dans le cours habituel des activités et dans des conditions commerciales normales.

Conseillers en investissement. Comme indiqué à la Note 4, tous les avoirs en banque des Fonds agréés par la SFC sont détenus soit par State Street Bank and Trust Co., en tant qu'agent du Dépositaire, soit directement auprès d'un sous-dépositaire. Le Dépositaire peut verser ou facturer des intérêts aux Fonds agréés par la SFC sur ces soldes de trésorerie.

18. CAPITAL SOCIAL

(a) Actions autorisées

Le capital social autorisé de la Société est de 38 092 € divisé en 30 000 actions de souscripteur à 1,27 € chacune et 500 000 000 000 d'actions de participation sans valeur nominale initialement désignées comme actions non classées.

(b) Actions de souscripteur

Les 30 000 actions de souscripteur d'origine, à l'exception de sept d'entre elles, ont été rachetées. Les actions de souscripteur ne font pas partie de la Valeur Nette d'Inventaire de la Société et, de ce fait, sont déclarées dans les états financiers, au titre exclusif de cette note. De l'avis du Conseil, cette déclaration reflète la nature des activités de fonds d'investissement de la Société.

Notes relatives aux États financiers (suite)

(c) Actions de participation rachetables

Le capital-actions participatif émis est toujours égal à la Valeur Nette d'Inventaire des Fonds. Les actions de participation rachetables sont rachetables au gré des actionnaires et classées en tant que passifs financiers. La variation du nombre d'actions de participation pour les exercices clos les 31 décembre 2023 et 31 décembre 2022 était comme suit (en milliers) :

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 51 764 | 147 409 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (61 598) | (90 909) |
| | (9 834) | 56 500 |
| Distribution | | |
| Émises | 6 997 | 2 322 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 22 | 26 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 978) | (14 441) |
| | 3 041 | (12 093) |
| Institutions en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 34 | 26 623 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 361 | 1 749 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (28 747) | (1) |
| | (28 352) | 28 371 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 33 | 56 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (195) | (3 326) |
| | (162) | (3 270) |
| Distribution | | |
| Émises | 24 | 64 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (43) | (374) |
| | (19) | (310) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 8 032 | 42 800 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (35 936) | (49 261) |
| | (27 904) | (6 461) |
| Distribution | | |
| Émises | 335 | 10 911 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 50 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 092) | (15 600) |
| | (755) | (4 639) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 166 | 942 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (317) | (1 102) |
| | (151) | (160) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 026 | 1 996 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 274) | (5 990) |
| | (248) | (3 993) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite) | | |
| Institutions en RMB (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 930 | 52 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (25) | (9) |
| | 906 | 44 |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 133 | 471 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (435) | (1 508) |
| | (302) | (1 037) |
| Distribution | | |
| Émises | 308 | 1 782 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 140) | (23 044) |
| | (2 832) | (21 262) |
| Investisseurs en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 18 | 14 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (39) |
| | 21 | (22) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 29 | 36 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 5 | 4 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (20) |
| | 34 | 20 |
| Investisseurs en RMB (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (158) | (94) |
| | (156) | (93) |
| Investisseurs en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 56 | 94 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (180) | (256) |
| | (124) | (162) |
| Administrations : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 522 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (549) | (2 214) |
| | (549) | (692) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 454 | 2 822 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 704) | (3 457) |
| | (1 250) | (635) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite) | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 462 | 1 198 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 81 | 74 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 236) | (4 616) |
| | (693) | (3 344) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 16 | 143 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (54) | (148) |
| | (38) | (5) |
| Distribution | | |
| Émises | 2 | 4 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5) | 0 |
| | (3) | 4 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 432 | 1 933 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 192) | (2 255) |
| | (760) | (322) |
| Distribution | | |
| Émises | 449 | 384 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 15 | 12 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (369) | (333) |
| | 95 | 63 |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : Distribution | | |
| Émises | 23 | 408 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 4 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (112) | (30) |
| | (85) | 381 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 289 | 283 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 29 | 26 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (567) | (1 065) |
| | (249) | (756) |
| H Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 152 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 152 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 6 | 5 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (34) | (6) |
| | (28) | (1) |
| M Détail : Distribution II | | |
| Émises | 1 020 | 403 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 32 | 27 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (690) | (477) |
| | 362 | (47) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite) | | |
| M Détail en HKD (non couverte) : Distribution II | | |
| Émises | 400 | 339 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (385) | (842) |
| | 18 | (501) |
| M Détail en SGD (couverte) : Distribution II | | |
| Émises | 43 | 43 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 20 | 16 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (206) | (89) |
| | (143) | (30) |
| Catégorie Z : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 622 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 959) | (4 918) |
| | (4 959) | (3 296) |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 6 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 6 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 6 874 | 6 037 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 129 | 90 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 473) | (6 309) |
| | (2 470) | (182) |
| Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 2 569 | 4 068 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13 619) | (2 641) |
| | (11 050) | 1 427 |
| Institutions en GBP (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 19 | 6 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2) | 0 |
| | 18 | 7 |
| Institutions en SGD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 1 481 | 2 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (14) | (101) |
| | 1 467 | (99) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite) | | |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 26 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 26 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 321 | 97 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (138) | (4) |
| | 183 | 93 |
| Distribution | | |
| Émises | 446 | 1 119 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 386) | (687) |
| | (939) | 435 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 85 | 217 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (57) | (69) |
| | 28 | 148 |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 45 | 146 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (270) | (349) |
| | (225) | (203) |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 10 | 5 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 10 | 5 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 397 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 5 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (20) | 0 |
| | 382 | 1 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite) | | |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 38 | 66 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (382) | (432) |
| | (344) | (366) |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 548) | (609) |
| | (3 548) | (609) |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 13 | 49 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (126) | (94) |
| | (113) | (45) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 674 | 3 042 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 550) | (7 884) |
| | (3 876) | (4 842) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 35 | 10 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (321) | (24) |
| | (286) | (14) |
| Institutions en RMB (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 73 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 73 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Institutions en RMB (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite) | | |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 135 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9) | (2) |
| | (9) | 133 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 143 | 254 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (399) | (278) |
| | (256) | (24) |
| Distribution | | |
| Émises | 120 | 520 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (267) | (245) |
| | (146) | 276 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 389 | 5 168 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 614) | (3 215) |
| | (225) | 1 953 |
| Distribution | | |
| Émises | 1 008 | 1 520 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 471) | (1 000) |
| | (463) | 520 |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| M Détail : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution II | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite) | | |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 8 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 8 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 8 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 8 | S/O |
| Distribution II | | |
| Émises | 8 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 8 | S/O |
| M Détail en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 137 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 137 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution II | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 496 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 471) | (711) |
| | (3 975) | (711) |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 24 877 | 26 728 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (34 467) | (61 431) |
| | (9 590) | (34 703) |
| Distribution | | |
| Émises | 5 121 | 7 801 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 16 | 18 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (25 954) | (30 396) |
| | (20 817) | (22 577) |
| Institutions en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---|---------------------|---|---|---------------------|
| | Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite) | | | Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite) | |
| Institutions en BRL (couverte) : | | | Distribution | | |
| Capitalisation | | | Émises | 728 | 1 282 |
| Émises | 353 | 626 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Rachetées au cours de l'exercice | (3 190) | (15 075) |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 121) | (3 441) | | (2 462) | (13 793) |
| | (1 768) | (2 815) | Investisseurs en AUD (couverte) : | | |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | Distribution | | |
| Capitalisation | | | Émises | 193 | 1 565 |
| Émises | 292 | 862 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Rachetées au cours de l'exercice | (62) | (2 624) |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 444) | (4 292) | | 131 | (1 059) |
| | (1 152) | (3 430) | Investisseurs en CAD (couverte) : | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | Distribution | | |
| Capitalisation | | | Émises | 8 | 0 |
| Émises | 30 167 | 40 278 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (48 188) | (71 053) | | 10 | 1 |
| | (18 021) | (30 775) | Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Distribution | | | Capitalisation | | |
| Émises | 11 212 | 796 | Émises | 195 | 397 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 35 | 20 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (11 801) | (2 261) | Rachetées au cours de l'exercice | (310) | (2 020) |
| | (554) | (1 445) | | (115) | (1 623) |
| Distribution II | | | Investisseurs en GBP (couverte) : | | |
| Émises | 395 | 134 | Distribution | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises | 74 | 61 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 687) | (489) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | (3 292) | (355) | Rachetées au cours de l'exercice | (50) | (86) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | 24 | (25) |
| Capitalisation | | | Investisseurs en RMB (couverte) : | | |
| Émises | 2 079 | 743 | Distribution | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 478) | (921) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | 601 | (178) | Rachetées au cours de l'exercice | (313) | (17) |
| Distribution | | | | (313) | (17) |
| Émises | 1 424 | 1 859 | Investisseurs en SGD (couverte) : | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 6 | Distribution | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 875) | (3 868) | Émises | 154 | 320 |
| | (450) | (2 003) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Institutions en RMB (couverte) : | | | Rachetées au cours de l'exercice | (367) | (174) |
| Distribution | | | | (213) | 146 |
| Émises | S/O | 0 | Administrations : | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 | Capitalisation | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) | Émises | 1 131 | 2 926 |
| | S/O | (1) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | Rachetées au cours de l'exercice | (1 771) | (2 384) |
| Distribution | | | | (640) | 542 |
| Émises | 283 | 17 | Distribution | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 5 | 0 | Émises | 465 | 527 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (14) | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 20 | 13 |
| | 274 | 17 | Rachetées au cours de l'exercice | (2 421) | (2 116) |
| Investisseurs : | | | | (1 936) | (1 576) |
| Capitalisation | | | Distribution II | | |
| Émises | 2 959 | 1 648 | Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 986) | (8 354) | Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | (3 027) | (6 706) | | 0 | 1 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite) | | |
| Administrations en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 278 | 62 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (467) | (243) |
| | (189) | (181) |
| Administrations en SGD (couverte) : Distribution II | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 3 758 | 4 440 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 866) | (7 660) |
| | (5 108) | (3 220) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 004 | 1 173 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 11 | 15 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 671) | (3 171) |
| | (656) | (1 983) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 58 | 100 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (324) | (247) |
| | (266) | (147) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 8 103 | 4 671 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 010) | (6 757) |
| | (907) | (2 086) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 322 | 1 329 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 352) | (1 068) |
| | (29) | 263 |
| M Détail : Distribution II | | |
| Émises | 3 457 | 6 498 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 38 | 43 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 448) | (10 686) |
| | (1 953) | (4 145) |
| M Détail en HKD (non couverte) : Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (45) | (1 913) |
| | (45) | (1 913) |
| M Détail en SGD (couverte) : Distribution II | | |
| Émises | 2 605 | 2 290 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 27 | 23 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 843) | (4 641) |
| | (211) | (2 328) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite) | | |
| Catégorie R : Distribution | | |
| Émises | 108 | 64 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (120) | (89) |
| | (12) | (25) |
| Catégorie R en EUR (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 13 | 23 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (196) | (811) |
| | (183) | (788) |
| Catégorie R en GBP (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 20 | 29 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (56) | (280) |
| | (36) | (249) |
| Catégorie T : Distribution | | |
| Émises | 47 | 199 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 8 | 7 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (107) | (333) |
| | (52) | (127) |
| Catégorie T en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 736 | 641 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 236) | (1 335) |
| | (500) | (694) |
| Catégorie Z : Distribution | | |
| Émises | 2 213 | 95 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 462 | 463 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 323) | (3 061) |
| | (648) | (2 503) |
| Catégorie Z en AUD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 1 524 | 1 779 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 485 | 578 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 634) | (2 578) |
| | (2 625) | (221) |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 1 358 | 1 367 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 715) | (359) |
| | (357) | 1 008 |
| Institutions en AUD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 245 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (30) | S/O |
| | 216 | S/O |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|--|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite) | | | Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite) | | |
| Institutions en CHF (couverte) : Capitalisation | | | Administrations en SEK (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 11 | 7 | Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (29) | (6) | Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | (18) | 1 | | 0 | 0 |
| Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | | Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 1 064 | 4 564 | Émises | 390 | 629 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 975) | (5 279) | Rachetées au cours de l'exercice | (422) | (438) |
| | (2 911) | (715) | | (32) | 191 |
| Distribution | | | Catégorie Z : Capitalisation | | |
| Émises | 5 036 | 154 | Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 106) | (1 564) | Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | (70) | (1 410) | | 0 | 0 |
| Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation | | | Fonds Commodity Real Return Fund | | |
| Émises | 1 502 | 1 673 | Institutions : Capitalisation | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises | 17 518 | 40 486 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 218) | (752) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | (716) | 921 | Rachetées au cours de l'exercice | (23 728) | (66 747) |
| Distribution | | | | (6 210) | (26 261) |
| Émises | 1 982 | 4 497 | Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 11 | Émises | 11 718 | 27 911 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 005) | (1 602) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | 977 | 2 906 | Rachetées au cours de l'exercice | (22 376) | (20 593) |
| Institutions en SEK (couverte) : Capitalisation | | | | (10 658) | 7 318 |
| Émises | 356 | 496 | Institutions en EUR (non couverte) : Capitalisation | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises | 1 128 | 3 509 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 554) | (29) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | (3 198) | 467 | Rachetées au cours de l'exercice | (3 016) | (1 319) |
| Institutions en SGD (couverte) : Capitalisation | | | | (1 888) | 2 190 |
| Émises | 139 | 203 | Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises | 894 | 2 237 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (172) | (109) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | (33) | 94 | Rachetées au cours de l'exercice | (2 320) | (2 286) |
| Investisseurs : Capitalisation | | | | (1 426) | (49) |
| Émises | S/O | 5 | Institutions en GBP (non couverte) : Distribution | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 | Émises | 872 | 1 888 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (326) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | S/O | (321) | Rachetées au cours de l'exercice | (413) | (7) |
| Capitalisation | | | | 459 | 1 881 |
| Émises | 1 | S/O | Investisseurs : Capitalisation | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O | Émises | 124 | 5 082 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | 1 | S/O | Rachetées au cours de l'exercice | (3 273) | (7 606) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : Capitalisation | | | | (3 149) | (2 524) |
| Émises | S/O | 0 | | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 | | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) | | | |
| | S/O | (1) | | | |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Commodity Real Return Fund (suite) | | |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 515 | 25 761 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13 233) | (28 579) |
| | (10 718) | (2 818) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 150 | 38 450 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (19 021) | (40 323) |
| | (15 871) | (1 873) |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 73 | 1 644 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (137) | (1 495) |
| | (64) | 149 |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 521 | 428 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (162) | (1) |
| | 359 | 427 |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 201 | 191 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (238) | (218) |
| | (37) | (27) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (395) | (560) |
| | (395) | (560) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 150 | 235 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (206) | (2 059) |
| | (56) | (1 824) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 122 | 231 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (185) | (259) |
| | (63) | (28) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 104 | 65 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (85) | (248) |
| | 19 | (183) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Diversified Income Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 164 | 3 884 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (12 981) | (13 073) |
| | (10 817) | (9 189) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 030 | 1 885 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 674 | 574 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 990) | (18 694) |
| | (5 286) | (16 235) |
| Institutions en CAD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 367 | 1 524 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 651) | (5 130) |
| | (1 284) | (3 606) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 150 | 212 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (384) | (284) |
| | (234) | (72) |
| Distribution | | |
| Émises | 36 | 193 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (423) | (494) |
| | (387) | (301) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 10 183 | 15 813 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (21 072) | (41 537) |
| | (10 889) | (25 724) |
| Distribution | | |
| Émises | 442 | 25 908 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 110 | 342 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17 729) | (69 909) |
| | (17 177) | (43 659) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 534 | 1 458 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 883) | (37 733) |
| | (7 349) | (36 275) |
| Distribution | | |
| Émises | 9 937 | 16 091 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 407 | 512 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (32 986) | (30 848) |
| | (22 642) | (14 245) |
| Institutions en MXN (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 239 | 3 007 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 406) | (2 975) |
| | 833 | 32 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------------------|---------------------|
| | Fonds Diversified Income Fund (suite) | |
| Institutions en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 16 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (16) | 0 |
| | 0 | 1 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 423 | 1 322 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 807) | (3 829) |
| | (4 384) | (2 507) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 154 | 1 949 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 774) | (3 263) |
| | (1 620) | (1 314) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 879 | 9 350 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 18 | 16 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 389) | (5 393) |
| | 508 | 3 973 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 203 | 177 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (509) | (660) |
| | (306) | (483) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | 317 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (160) | (202) |
| | (159) | 115 |
| Administrations : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 314 | 1 604 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 29 | 25 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 566) | (4 583) |
| | (2 223) | (2 954) |
| Administrations en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 6 | 14 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (347) | (43) |
| | (341) | (29) |
| Administrations en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 20 | 46 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (109) | (315) |
| | (89) | (269) |
| Administrations en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 12 | 50 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (114) | (246) |
| | (102) | (196) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------------------|---------------------|
| | Fonds Diversified Income Fund (suite) | |
| Administrations en JPY (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 27 | 391 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (24) | 0 |
| | 3 | 391 |
| Administrations en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 0 |
| Administrations en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 2 496 | 640 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 29 | 23 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 796) | (3 780) |
| | 729 | (3 117) |
| BM Détail : | | |
| Décumulation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution II | | |
| Émises | 4 067 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (440) | 0 |
| | 3 627 | 1 |
| BN Détail : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1) | 0 |
| | (1) | 1 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 399 | 4 099 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 495) | (17 311) |
| | (6 096) | (13 212) |
| Distribution | | |
| Émises | 2 160 | 5 389 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 107 | 93 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 742) | (17 485) |
| | (7 475) | (12 003) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 24 | 65 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (279) | (86) |
| | (255) | (21) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 7 949 | 15 932 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (37 557) | (33 142) |
| | (29 608) | (17 210) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------------------|---------------------|
| | Fonds Diversified Income Fund (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | 3 943 | 4 672 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (23 603) | (37 797) |
| | (19 657) | (33 123) |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 262 | 22 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (943) | (1 940) |
| | (679) | (1 917) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 30 370 | 17 461 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (28 561) | (66 418) |
| | 1 809 | (48 957) |
| Distribution | | |
| Émises | 8 | 13 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (1) |
| | 8 | 12 |
| M Détail : | | |
| Décumulation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 1 300 | 1 664 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 46 | 38 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 061) | (6 706) |
| | (2 715) | (5 004) |
| Distribution II | | |
| Émises | 5 300 | 9 583 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 314) | (17 798) |
| | (3 012) | (8 213) |
| M Détail en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 577 | 942 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 360) | (2 811) |
| | (781) | (1 868) |
| M Détail en SGD (couverte) : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| N Détail : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 0 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------------------|---------------------|
| | Fonds Diversified Income Fund (suite) | |
| Catégorie T : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 78 | 175 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (357) | (943) |
| | (279) | (768) |
| Distribution | | |
| Émises | 51 | 44 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 7 | 5 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (150) | (154) |
| | (92) | (105) |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 444 | 337 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (645) | (1 070) |
| | (201) | (733) |
| Distribution | | |
| Émises | 288 | 129 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (401) | (490) |
| | (113) | (361) |
| Catégorie W : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 94 | 1 342 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 357) | (5 541) |
| | (4 263) | (4 199) |
| Distribution | | |
| Émises | 98 | 393 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 418) | (8 527) |
| | (4 320) | (8 134) |
| Catégorie W en CAD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| Catégorie W en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 32 | 456 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 175) | (478) |
| | (1 143) | (22) |
| Distribution | | |
| Émises | 9 | 82 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (44) | (153) |
| | (35) | (71) |
| Catégorie W en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 22 | 607 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (890) | (675) |
| | (868) | (68) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Diversified Income Fund (suite) | | |
| Distribution | | |
| Émises | 10 | 146 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (311) | (393) |
| | (301) | (247) |
| Catégorie W en GBP (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 82 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (213) | (68) |
| | (213) | 14 |
| Distribution | | |
| Émises | 61 | 109 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (387) | (100) |
| | (326) | 9 |
| Catégorie W en SGD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 0 | 165 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (193) | (257) |
| | (193) | (92) |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 235 | 129 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (655) | (2 800) |
| | (420) | (2 671) |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (326) |
| | S/O | (326) |
| Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 760 | 2 538 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 619) | (7 903) |
| | (5 859) | (5 365) |
| Distribution II | | |
| Émises | 6 | 22 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (112) | (3 662) |
| | (106) | (3 640) |
| Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 161 | 272 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 121) | (8 534) |
| | (2 960) | (8 262) |
| Distribution | | |
| Émises | 72 | 92 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 758) | (12 053) |
| | (2 686) | (11 961) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite) | | |
| Investisseurs : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 4 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (39) | (454) |
| | (39) | (450) |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 147 | 632 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (726) | (2 383) |
| | (579) | (1 751) |
| Distribution | | |
| Émises | 103 | 436 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 5 | 4 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (426) | (669) |
| | (318) | (229) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 371 | 1 162 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 783) | (11 254) |
| | (1 412) | (10 092) |
| Distribution | | |
| Émises | 375 | 99 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (523) | (1 054) |
| | (148) | (955) |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 947 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 947 |
| Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 4 610 | 23 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (577) | 0 |
| | 4 033 | 23 |
| Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 19 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 19 |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|-------------------------|---------------------|
| | Fonds Dynamic Bond Fund | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 7 291 | 3 696 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (18 596) | (11 498) |
| | (11 305) | (7 802) |
| Distribution | | |
| Émises | 153 | 229 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 4 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (151) | (1 057) |
| | 6 | (825) |
| Institutions en CAD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (187) | (212) |
| | (187) | (212) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 10 | 1 034 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 804) | (1 834) |
| | (6 794) | (800) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 249 | 11 147 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10 648) | (21 791) |
| | (8 399) | (10 644) |
| Distribution | | |
| Émises | 57 | 570 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (693) | (559) |
| | (635) | 11 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 18 097 | 100 815 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (20 444) | (15 420) |
| | (2 347) | 85 395 |
| Distribution | | |
| Émises | 416 | 1 066 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 42 | 56 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (550) | (16 302) |
| | (92) | (15 180) |
| Institutions en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 6 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (64) | (9 634) |
| | (64) | (9 628) |
| Institutions en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (238) |
| | S/O | (237) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------------|---------------------|
| | Fonds Dynamic Bond Fund (suite) | |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 257 | 483 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (678) | (951) |
| | (421) | (468) |
| Distribution | | |
| Émises | 2 | 11 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 5 | 6 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (183) | (94) |
| | (176) | (77) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10) | (312) |
| | (5) | (312) |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 31 | 61 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (569) | (530) |
| | (538) | (469) |
| Administrations en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 46 | 7 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (68) | (197) |
| | (22) | (190) |
| Administrations en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 17 | 18 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (99) | (139) |
| | (82) | (121) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 040 | 1 408 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 587) | (2 734) |
| | (547) | (1 326) |
| Distribution | | |
| Émises | 105 | 218 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 12 | 8 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (281) | (473) |
| | (164) | (247) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 28 | 99 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (178) | (177) |
| | (150) | (78) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 456 | 412 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 298) | (5 226) |
| | (842) | (4 814) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Dynamic Bond Fund (suite) | | |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 7 | 21 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (156) | (31) |
| | (149) | (10) |
| G Détail en EUR (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 14 | 12 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (174) | (108) |
| | (160) | (96) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 672 | 730 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 749) | (1 272) |
| | 2 923 | (542) |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1) | 0 |
| | (1) | 0 |
| Catégorie R : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 9 | 38 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (178) | (103) |
| | (169) | (65) |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 575 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (724) | (276) |
| | 851 | (276) |
| Catégorie Z en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 111 | 145 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 97 | 101 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 379) | (821) |
| | (1 171) | (575) |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 10 113 | 16 762 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (61 089) | (78 040) |
| | (50 976) | (61 278) |
| Distribution II | | |
| Émises | 774 | 971 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 964) | (4 764) |
| | (3 190) | (3 793) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 4 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (52) | (145) |
| | (52) | (141) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite) | | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 9 976 | 13 616 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (21 764) | (9 604) |
| | (11 788) | 4 012 |
| Distribution | | |
| Émises | 66 | 2 347 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 136) | (659) |
| | (2 070) | 1 688 |
| Institutions en ILS (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 438 | 423 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (193) | 0 |
| | 1 245 | 423 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 52 | 9 784 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 235) | 0 |
| | (3 183) | 9 784 |
| Institutions en USD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 695 | 2 374 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 969) | (9 023) |
| | (3 274) | (6 649) |
| Distribution II | | |
| Émises | 0 | 20 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (1) |
| | 0 | 19 |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 23 | 131 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (149) | (4) |
| | (126) | 127 |
| Investisseurs en USD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1) | 0 |
| | (1) | 0 |
| BM Détail en AUD (couverte) : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 39 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (22) | 0 |
| | 17 | 1 |
| BM Détail en USD (couverte) : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 162 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (96) | 0 |
| | 66 | 1 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---|---------------------|---|---|---------------------|
| | Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite) | | | Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite) | |
| Catégorie E : | | | Catégorie T en USD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | | Capitalisation | | |
| Émises | 7 284 | 17 931 | Émises | 38 | 349 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (78 046) | (71 978) | Rachetées au cours de l'exercice | (84) | (13) |
| | (70 762) | (54 047) | | (46) | 336 |
| Distribution | | | Catégorie Z : | | |
| Émises | 1 | 67 | Capitalisation | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises | 40 | 17 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (146) | (78) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | (145) | (11) | Rachetées au cours de l'exercice | (4 450) | (1 434) |
| Catégorie E en USD (couverte) : | | | | (4 410) | (1 417) |
| Capitalisation | | | | Fonds Emerging Local Bond Fund | |
| Émises | 646 | 2 719 | Institutions : | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Capitalisation | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 514) | (6 818) | Émises | 38 848 | 44 501 |
| | (5 868) | (4 099) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Distribution | | | Rachetées au cours de l'exercice | (19 232) | (46 912) |
| Émises | 0 | 3 | | 19 616 | (2 411) |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Distribution | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4) | 0 | Émises | 2 085 | 152 |
| | (4) | 3 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Distribution II | | | Rachetées au cours de l'exercice | (186) | (456) |
| Émises | 0 | 0 | | 1 899 | (304) |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Institutions en CHF (non couverte) : | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1) | 0 | Capitalisation | | |
| | (1) | 0 | Émises | S/O | 0 |
| H Institutions en USD (couverte) : | | | Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Capitalisation | | | Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (44) |
| Émises | 0 | 1 976 | | S/O | (44) |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Institutions en EUR (non couverte) : | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (173) | (2 546) | Capitalisation | | |
| | (173) | (570) | Émises | 23 946 | 7 070 |
| M Détail en AUD (couverte) : | | | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Distribution II | | | Rachetées au cours de l'exercice | (9 118) | (12 977) |
| Émises | 24 | 13 | | 14 828 | (5 907) |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 | Distribution | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (23) | (32) | Émises | 5 342 | 6 133 |
| | 2 | (18) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| M Détail en SGD (couverte) : | | | Rachetées au cours de l'exercice | (2 538) | (3 859) |
| Distribution II | | | | 2 804 | 2 274 |
| Émises | 53 | 93 | Institutions en GBP (non couverte) : | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 4 | 6 | Capitalisation | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (437) | (234) | Émises | 241 | 141 |
| | (380) | (135) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| M Détail en USD (couverte) : | | | Rachetées au cours de l'exercice | (144) | (78) |
| Distribution II | | | | 97 | 63 |
| Émises | 88 | 1 806 | Investisseurs : | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 5 | Capitalisation | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 215) | (5 705) | Émises | 542 | 232 |
| | (2 124) | (3 894) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Catégorie T : | | | Rachetées au cours de l'exercice | (1 796) | (2 010) |
| Capitalisation | | | | (1 254) | (1 778) |
| Émises | 504 | 616 | Investisseurs en EUR (non couverte) : | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Capitalisation | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 986) | (2 236) | Émises | 2 | 21 |
| | (1 482) | (1 620) | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| | | | Rachetées au cours de l'exercice | (13) | (276) |
| | | | | (11) | (255) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Emerging Local Bond Fund (suite) | | |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 988 | 2 431 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 951) | (2 501) |
| | 37 | (70) |
| Distribution | | |
| Émises | 405 | 191 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (278) | (418) |
| | 129 | (226) |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 285 | 625 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 011) | (1 405) |
| | 274 | (780) |
| Distribution | | |
| Émises | 9 | 7 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10) | (28) |
| | (1) | (21) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 67 149 | 5 708 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (54 102) | (293) |
| | 13 047 | 5 415 |
| Catégorie Z : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 252 | 277 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 093) | 0 |
| | (1 841) | 277 |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 489 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 489 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 7 663 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 7 663 | 1 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite) | | |
| Institutions en GBP (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Investisseurs en EUR (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 123 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 123 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 8 371 | 10 925 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 515) | (15 619) |
| | 856 | (4 694) |
| Distribution | | |
| Émises | 2 723 | 688 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 76 | 85 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (750) | (1 874) |
| | 2 049 | (1 101) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 271 | 232 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (314) | (57) |
| | (43) | 175 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 709 | 12 568 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 109) | (8 822) |
| | (1 400) | 3 746 |
| Distribution | | |
| Émises | 11 405 | 31 500 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 20 | 90 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 785) | (68 483) |
| | 3 640 | (36 893) |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 6 372 | 5 590 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 603) | (6 467) |
| | 2 768 | (877) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 42 | 235 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (239) | (160) |
| | (197) | 75 |
| Distribution | | |
| Émises | 3 380 | 2 143 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 169 | 133 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 378) | (3 367) |
| | (829) | (1 091) |
| Institutions en PLN (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (9 928) |
| | S/O | (9 927) |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 658 | 1 303 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 619) | (828) |
| | (961) | 475 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite) | | |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 15 | 7 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (14) | (54) |
| | 1 | (47) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (8) |
| | 0 | (8) |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 165 | 82 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (66) | (215) |
| | 99 | (133) |
| BM Détail : | | |
| Décumulation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution II | | |
| Émises | 138 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (47) | 0 |
| | 91 | 1 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 290 | 847 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 092) | (1 406) |
| | 198 | (559) |
| Distribution | | |
| Émises | 5 539 | 7 933 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 13 | 12 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 348) | (10 704) |
| | 204 | (2 759) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 827 | 541 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (857) | (1 372) |
| | (30) | (831) |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 87 | 79 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (109) | (70) |
| | (22) | 9 |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 6 142 | 7 545 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 510) | (6 018) |
| | 1 632 | 1 527 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---|---------------------|
| | Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | 5 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 5 | 0 |
| M Détail : | | |
| Décumulation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 213 | 112 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 6 | 5 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (298) | (246) |
| | (79) | (129) |
| Distribution II | | |
| Émises | 9 169 | 16 994 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 036) | (16 949) |
| | 133 | 45 |
| M Détail en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 662 | 12 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (169) | (587) |
| | 493 | (575) |
| Catégorie Z : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 264 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 72 | 31 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 1 336 | 31 |
| | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 9 063 | 19 358 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 642) | (11 060) |
| | 421 | 8 298 |
| Distribution | | |
| Émises | 6 614 | 13 168 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 70 | 178 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (12 399) | (3 833) |
| | (5 715) | 9 513 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 31 006 | 1 769 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 689) | (11) |
| | 24 317 | 1 758 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 16 806 | 56 354 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (33 770) | (32 858) |
| | (16 964) | 23 496 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---|---------------------|
| | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | 15 413 | 30 800 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 77 | 114 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13 847) | (32 730) |
| | 1 643 | (1 816) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 4 924 | 16 488 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13 019) | (2 491) |
| | (8 093) | 13 999 |
| Institutions en GBP (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 410 | 239 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (217) | (138) |
| | 193 | 101 |
| Investisseurs en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10) | 0 |
| | (10) | 0 |
| Investisseurs en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 159 | 308 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (180) | (105) |
| | (21) | 203 |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (22) |
| | 0 | (22) |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (6) |
| | 0 | (6) |
| Administrations en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 | 4 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1) | (4) |
| | 2 | 0 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 354 | 27 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (67) | (65) |
| | 287 | (38) |
| Distribution | | |
| Émises | 8 | 32 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (35) | (30) |
| | (27) | 2 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite) | | | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite) | | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | | Institutions en GBP (partiellement couverte) : Distribution | | |
| Émises | 1 801 | 4 801 | Émises | 0 | 79 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 4 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 163) | (9 874) | Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | (362) | (5 073) | | 4 | 81 |
| Catégorie Z : Capitalisation | | | Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 467 | S/O | Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (114) | S/O | Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 353 | S/O | | 1 | S/O |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | | | Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | | Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 267 | 792 | Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (69) | (789) | Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (8) |
| | 198 | 3 | | S/O | (8) |
| Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | | Institutions en EUR (non couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 28 | 814 | Émises | 170 | 451 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 229) | (325) | Rachetées au cours de l'exercice | (199) | (757) |
| | (1 201) | 489 | | (29) | (306) |
| Catégorie E : Capitalisation | | | Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 26 | 192 | Émises | 30 | 36 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (438) | (518) | Rachetées au cours de l'exercice | (86) | (82) |
| | (412) | (326) | | (56) | (46) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation | | | Catégorie E en EUR (non couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 10 | 2 | Émises | 56 | 63 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (163) | (189) | Rachetées au cours de l'exercice | (170) | (215) |
| | (153) | (187) | | (114) | (152) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | | | | |
| Émises | 87 | 59 | | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (335) | (352) | | | |
| | (248) | (293) | | | |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | | | | |
| Institutions : Capitalisation | | | | | |
| Émises | 4 184 | 2 229 | | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 045) | (4 163) | | | |
| | 3 139 | (1 934) | | | |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) : Capitalisation | | | | | |
| Émises | 743 | 1 044 | | | |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 | | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (888) | (13 456) | | | |
| | (145) | (12 412) | | | |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|-----------------------------|---------------------|
| | Fonds PIMCO ESG Income Fund | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 541 | 2 231 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 611) | (286) |
| | 1 930 | 1 945 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 8 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 10 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (395) | 0 |
| | (392) | 18 |
| Institutions en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 632 | 6 278 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 149 | 59 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (165) | 0 |
| | 1 616 | 6 337 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 183 | 735 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (849) | (1) |
| | (666) | 734 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 6 362 | 7 700 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13 304) | (3 366) |
| | (6 942) | 4 334 |
| Distribution | | |
| Émises | 4 618 | 237 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (27) | (42) |
| | 4 591 | 195 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 5 | 3 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8) | (7) |
| | (2) | (4) |
| Institutions en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 912 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (144) | S/O |
| | 2 768 | S/O |
| Institutions en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 533 | 563 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 533 | 563 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 6 | 3 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2) | 0 |
| | 5 | 4 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|-------------------------------------|---------------------|
| | Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite) | |
| Administrations en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 431 | 826 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (724) | (10) |
| | (293) | 816 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 148 | 176 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (54) | (49) |
| | 94 | 127 |
| Distribution | | |
| Émises | 23 | 44 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (18) | (3) |
| | 5 | 41 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 3 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3) | 0 |
| | 0 | 0 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 257 | 522 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (101) | (99) |
| | 156 | 423 |
| Distribution | | |
| Émises | 206 | 94 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (117) | (5) |
| | 89 | 89 |
| Catégorie R en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 556 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (575) | 0 |
| | (575) | 557 |
| | | |
| | Fonds Euro Bond Fund | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 14 605 | 11 908 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (30 638) | (21 387) |
| | (16 033) | (9 479) |
| Distribution | | |
| Émises | 498 | 651 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 279) | (1 169) |
| | (2 781) | (518) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 286 | 901 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (400) | (59) |
| | (114) | 842 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Euro Bond Fund (suite) | | |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 147 | 85 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (61) | (200) |
| | 86 | (115) |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (15) |
| | S/O | (15) |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (110) |
| | S/O | (110) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 693 | 486 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 050) | (1 701) |
| | 643 | (1 215) |
| Distribution | | |
| Émises | 415 | 120 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (410) | (929) |
| | 5 | (809) |
| Fonds Euro Credit Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 028 | 14 117 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 155) | (33 114) |
| | (2 127) | (18 997) |
| Distribution II | | |
| Émises | 520 | 9 070 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 34 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 680) | (14 528) |
| | (1 160) | (5 424) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 761 | 47 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 416) | (399) |
| | 2 345 | (352) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 439 | 12 991 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13 470) | (2 658) |
| | (12 031) | 10 333 |
| Distribution II | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9) | (167) |
| | (9) | (166) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Euro Income Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 7 409 | 8 116 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 964) | (40 863) |
| | (2 555) | (32 747) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 293 | 25 489 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 118 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 121) | (28 907) |
| | (1 828) | (3 300) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 579 | 31 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (179) | (283) |
| | 400 | (252) |
| Distribution | | |
| Émises | 61 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (151) | (90) |
| | (88) | (88) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 10 067 | 2 777 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10 698) | (19 331) |
| | (631) | (16 554) |
| Distribution | | |
| Émises | 6 657 | 1 837 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 952) | (13 945) |
| | (295) | (12 108) |
| Distribution Q | | |
| Émises | S/O | 19 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (425) |
| | S/O | (406) |
| Catégorie T : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 905 | 268 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (532) | (638) |
| | 373 | (370) |
| Distribution | | |
| Émises | 612 | 122 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (226) | (370) |
| | 386 | (248) |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 41 030 | 1 625 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 711) | (1 265) |
| | 38 319 | 360 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Euro Long Average Duration Fund (suite) | | |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Fonds Euro Short-Term Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 5 508 | 20 374 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (20 793) | (43 243) |
| | (15 285) | (22 869) |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 2 077 | 920 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (819) | (809) |
| | 1 258 | 111 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 20 217 | 3 858 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 749) | (1 638) |
| | 16 468 | 2 220 |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 389 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (30) | 0 |
| | 359 | 1 |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Catégorie Z : Capitalisation | | |
| Émises | 2 602 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 176) | (200) |
| | (1 574) | (200) |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 1 510 | 5 027 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 240) | (15 856) |
| | (5 730) | (10 829) |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 715 | 520 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite) | | |
| Rachetées au cours de l'exercice | (366) | (141) |
| | 349 | 379 |
| H Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 1 399 | 903 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 122) | (6 802) |
| | (2 723) | (5 899) |
| Fonds Global Advantage Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 41 | 36 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (83) | (1 084) |
| | (42) | (1 048) |
| Institutions en CHF (partiellement couverte) : Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (44) | (336) |
| | (44) | (336) |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 627 | 1 723 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 187) | (2 551) |
| | (560) | (828) |
| Institutions en GBP (partiellement couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (14) |
| | S/O | (14) |
| Institutions en NOK (partiellement couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 7 | 6 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 7 | 6 |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 31 | 47 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (98) | (100) |
| | (67) | (53) |
| Fonds Global Bond Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 52 900 | 20 005 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (25 562) | (24 316) |
| | 27 338 | (4 311) |
| Distribution | | |
| Émises | 3 821 | 1 853 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 59 | 52 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 358) | (2 143) |
| | 1 522 | (238) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|--------------------------------|---------------------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | |
| Institutions (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 6 845 | 3 622 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 166) | (1 873) |
| | (1 321) | 1 749 |
| Distribution | | |
| Émises | 11 | 29 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (80) | (127) |
| | (69) | (98) |
| Institutions en CAD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 43 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (742) | (914) |
| | (699) | (914) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 730 | 1 018 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 652) | (2 240) |
| | (2 922) | (1 222) |
| Distribution | | |
| Émises | 94 | 190 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 086) | (741) |
| | (1 991) | (550) |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 7 439 | 10 455 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 838) | (5 337) |
| | (399) | 5 118 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 20 966 | 19 257 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (24 690) | (25 423) |
| | (3 724) | (6 166) |
| Distribution | | |
| Émises | 11 765 | 1 488 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 23 | 20 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 707) | (2 934) |
| | 4 081 | (1 426) |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 42 | 16 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (152) | (22) |
| | (110) | (6) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 570 | 2 464 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 904) | (3 014) |
| | 666 | (550) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--------------------------------|---------------------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | 2 512 | 2 663 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 35 | 44 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 163) | (5 377) |
| | (1 616) | (2 670) |
| Institutions en ILS (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (18) |
| | S/O | (18) |
| Institutions en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 086 | 1 514 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 880) | (4 987) |
| | (2 794) | (3 473) |
| Institutions en NZD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 413 | 179 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 39 | 42 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 127) | (2 702) |
| | (675) | (2 481) |
| Institutions en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 484 | 1 489 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 984) | (1 203) |
| | (3 500) | 286 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 910 | 4 901 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 983) | (1 266) |
| | (73) | 3 635 |
| Distribution | | |
| Émises | 12 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1) | S/O |
| | 11 | S/O |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 534 | 654 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 361) | (1 502) |
| | 3 173 | (848) |
| Distribution | | |
| Émises | 3 170 | 1 669 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 590) | (184) |
| | 1 581 | 1 486 |
| Investisseurs (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (71) |
| | S/O | (71) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--------------------------------|---------------------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | |
| Investisseurs en CHF (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 409 | 195 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 456) | (1 649) |
| | (2 047) | (1 454) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 852 | 410 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (648) | (603) |
| | 204 | (193) |
| Investisseurs en GBP (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 57 | 25 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (12) | (9) |
| | 45 | 16 |
| Investisseurs en NOK (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 207 | 22 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (23) | (30) |
| | 184 | (8) |
| Administrations : Capitalisation | | |
| Émises | 198 | 255 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (96) | (413) |
| | 102 | (158) |
| Administrations en SEK (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 889 | 1 474 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (838) | (169) |
| | 51 | 1 305 |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 4 444 | 2 644 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 754) | (5 612) |
| | 690 | (2 968) |
| Distribution | | |
| Émises | 9 364 | 7 456 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 8 | 6 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 684) | (7 519) |
| | 2 688 | (57) |
| Catégorie E (exposition au risque de change) : Capitalisation | | |
| Émises | 1 297 | 386 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 161) | (1 781) |
| | 136 | (1 395) |
| Distribution | | |
| Émises | 884 | 256 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (283) | (306) |
| | 601 | (50) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|--------------------------------|---------------------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | |
| Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 171 | 26 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (124) | (37) |
| | 47 | (11) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 7 397 | 5 158 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 217) | (11 634) |
| | (820) | (6 476) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 706 | 741 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (788) | (1 225) |
| | 918 | (484) |
| Catégorie E en NOK (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| G Détail en EUR (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 1 467 | 191 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 442) | (4 603) |
| | 25 | (4 412) |
| H Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 19 106 | 34 334 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (21 135) | (33 907) |
| | (2 029) | 427 |
| Distribution | | |
| Émises | 14 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6) | (30) |
| | 8 | (30) |
| H Institutions (exposition au risque de change) : Capitalisation | | |
| Émises | 40 012 | 71 651 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (60 616) | (33 844) |
| | (20 604) | 37 807 |
| M Détail : Distribution II | | |
| Émises | 1 349 | 33 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 411) | (48) |
| | (61) | (15) |
| M Détail en HKD (non couverte) : Distribution II | | |
| Émises | 1 451 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13) | (227) |
| | 1 438 | (227) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--------------------------------|---------------------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | |
| M Détail en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| M Détail en SGD (couverte) : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 1 470 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (100) | S/O |
| | 1 370 | S/O |
| Catégorie R en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 106 | 161 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (89) | (159) |
| | 17 | 2 |
| Catégorie T : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 289 | 187 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (265) | (863) |
| | 24 | (676) |
| Distribution | | |
| Émises | 236 | 14 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (34) | (74) |
| | 203 | (59) |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 431 | 283 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (432) | (480) |
| | 999 | (197) |
| Catégorie W : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 10 994 | 1 762 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 518) | (2 003) |
| | 9 476 | (241) |
| Distribution | | |
| Émises | 5 155 | 645 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (297) | (458) |
| | 4 858 | 187 |
| Distribution II | | |
| Émises | 51 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 51 | S/O |
| Catégorie W (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--------------------------------|---------------------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| Catégorie W en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 336 | 502 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (529) | (970) |
| | 807 | (468) |
| Distribution | | |
| Émises | 476 | 36 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (36) | (26) |
| | 440 | 10 |
| Catégorie W en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 766 | 805 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (337) | (1 199) |
| | 1 429 | (394) |
| Distribution | | |
| Émises | 394 | 159 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (184) | (107) |
| | 210 | 52 |
| Catégorie W en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 526 | 206 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (51) | (64) |
| | 1 475 | 142 |
| Distribution | | |
| Émises | 546 | 249 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (281) | (478) |
| | 265 | (229) |
| Catégorie W en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 77 | 8 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1) | 0 |
| | 76 | 8 |
| Catégorie W en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| Catégorie W en SGD (couverte) : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 1 135 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (86) | S/O |
| | 1 049 | S/O |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|----------------------------|---------------------|
| | Fonds Global Bond ESG Fund | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 14 597 | 19 756 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17 039) | (10 249) |
| | (2 442) | 9 507 |
| Distribution | | |
| Émises | 651 | 6 056 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 7 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 915) | (1 272) |
| | (2 257) | 4 785 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 23 218 | 51 831 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 352) | (4 396) |
| | 13 866 | 47 435 |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 23 | 1 418 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (467) | (1 060) |
| | (444) | 358 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 44 250 | 71 834 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (52 147) | (27 284) |
| | (7 897) | 44 550 |
| Distribution | | |
| Émises | 1 224 | 3 526 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 593) | (3 843) |
| | (5 369) | (317) |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 72 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 72 | 1 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 13 566 | 670 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 331) | (2 038) |
| | 10 235 | (1 368) |
| Distribution | | |
| Émises | 28 417 | 4 565 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 7 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (29 333) | (2 443) |
| | (909) | 2 125 |
| Institutions en GBP (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 701 | 422 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 013) | (630) |
| | (1 312) | (208) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|------------------------------------|---------------------|
| | Fonds Global Bond ESG Fund (suite) | |
| Institutions en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 101 027 | 106 405 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (36 508) | (25 926) |
| | 64 519 | 80 479 |
| Institutions en NZD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 107 | 152 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 122 | 79 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (208) |
| | 229 | 23 |
| Institutions en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 166 | 1 625 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 064) | (1 496) |
| | (1 898) | 129 |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 582 | 569 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (198) | (813) |
| | 384 | (244) |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 5 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (213) |
| | S/O | (208) |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| Administrations en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 900 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (29) | S/O |
| | 871 | S/O |
| Catégorie E : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 98 | 251 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (39) | (39) |
| | 59 | 212 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 168 | 8 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4) | 0 |
| | 164 | 8 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 093 | 744 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (869) | (1 144) |
| | 224 | (400) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Bond ESG Fund (suite) | | |
| Catégorie Z en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 14 196 | 18 505 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 041 | 557 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 947) | (4 344) |
| | 12 290 | 14 718 |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 030 | 2 995 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 974) | (5 454) |
| | 56 | (2 459) |
| Distribution | | |
| Émises | 408 | 31 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 43 | 36 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (229) | (978) |
| | 222 | (911) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 776 | 1 935 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 263) | (434) |
| | (1 487) | 1 501 |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 11 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (21) | (427) |
| | (21) | (416) |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 14 | 14 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (79) | (35) |
| | (65) | (21) |
| Catégorie E : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 4 164 | 6 630 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 18 | 8 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 066) | (8 332) |
| | 1 116 | (1 694) |
| Catégorie E (exposition au risque de change) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 187 | 1 441 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 583) | (1 725) |
| | (1 395) | (284) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 10 646 | 8 239 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 106) | (7 676) |
| | 3 540 | 563 |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (2 092) |
| | 0 | (2 092) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Global High Yield Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 375 | 6 545 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 119) | (13 417) |
| | (744) | (6 872) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 357 | 966 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 58 | 51 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 852) | (14 027) |
| | (1 437) | (13 010) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 23 | 31 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (34) | (681) |
| | (11) | (650) |
| Distribution | | |
| Émises | 124 | 133 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (106) | (1 560) |
| | 18 | (1 427) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 6 295 | 7 994 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10 488) | (24 025) |
| | (4 193) | (16 031) |
| Distribution | | |
| Émises | 3 949 | 9 520 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 145 | 159 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 642) | (4 069) |
| | (2 548) | 5 610 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 736 | 1 473 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 117) | (13 780) |
| | 619 | (12 307) |
| Distribution | | |
| Émises | 14 947 | 22 851 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 53 | 46 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (33 322) | (59 227) |
| | (18 322) | (36 330) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 39 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (32) | (753) |
| | 7 | (753) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---|---------------------|
| | Fonds Global High Yield Bond Fund (suite) | |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 62 | 899 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (413) | (550) |
| | (351) | 349 |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 19 | 105 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (477) | (710) |
| | (458) | (605) |
| Distribution | | |
| Émises | 20 | 49 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (624) | (780) |
| | (604) | (731) |
| Administrations en EUR (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (197) |
| | S/O | (196) |
| Administrations en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (107) |
| | S/O | (106) |
| BM Détail : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 407 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (84) | 0 |
| | 323 | 1 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 771 | 1 171 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 608) | (2 802) |
| | (837) | (1 631) |
| Distribution | | |
| Émises | 9 437 | 14 617 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 23 | 22 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (11 547) | (16 703) |
| | (2 087) | (2 064) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 838 | 3 171 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 761) | (4 821) |
| | (923) | (1 650) |
| Distribution | | |
| Émises | 411 | 290 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (581) | (810) |
| | (169) | (520) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---|---------------------|
| | Fonds Global High Yield Bond Fund (suite) | |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 7 | 6 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (261) | (29) |
| | (254) | (23) |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 392 | 193 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 15 | 9 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (253) | (607) |
| | 154 | (405) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 6 200 | 11 210 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10 385) | (5 391) |
| | (4 185) | 5 819 |
| Distribution | | |
| Émises | 1 326 | 165 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (980) | (767) |
| | 347 | (602) |
| M Détail : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 101 | 326 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (302) | (769) |
| | (198) | (441) |
| Distribution II | | |
| Émises | 16 140 | 23 666 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (16 524) | (30 871) |
| | (384) | (7 205) |
| Catégorie R : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 7 | 834 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (39) | (5 248) |
| | (32) | (4 414) |
| Catégorie T : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 57 | 15 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (72) | (121) |
| | (15) | (106) |
| Distribution | | |
| Émises | 101 | 15 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (24) | (42) |
| | 77 | (27) |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (130) |
| | S/O | (130) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--|---------------------|
| | Fonds Global Investment Grade Credit Fund | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 63 058 | 44 338 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (55 616) | (76 437) |
| | 7 442 | (32 099) |
| Distribution | | |
| Émises | 21 079 | 7 013 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 132 | 125 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13 586) | (16 764) |
| | 7 625 | (9 626) |
| Institutions (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 703 | 3 744 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (230) | (1 549) |
| | 473 | 2 195 |
| Distribution | | |
| Émises | 459 | 221 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 031) | (735) |
| | (572) | (514) |
| Institutions en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 170 | 95 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (326) | (7 762) |
| | (156) | (7 667) |
| Institutions en CAD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 35 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (37) |
| | S/O | (1) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 712 | 6 544 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (14 828) | (7 451) |
| | (10 116) | (907) |
| Distribution | | |
| Émises | 888 | 521 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 219) | (1 364) |
| | (330) | (842) |
| Institutions en CZK (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 1 556 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (19 074) | (176 854) |
| | (19 074) | (175 298) |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 890 | 1 445 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (830) | (741) |
| | 60 | 704 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|--|---------------------|
| | Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 22 662 | 28 528 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (46 697) | (58 533) |
| | (24 035) | (30 005) |
| Distribution | | |
| Émises | 6 707 | 7 044 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 13 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (16 660) | (27 790) |
| | (9 953) | (20 733) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 236 | 1 218 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 086) | (6 780) |
| | 150 | (5 562) |
| Distribution | | |
| Émises | 26 883 | 12 235 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 46 | 31 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (41 147) | (66 400) |
| | (14 218) | (54 134) |
| Institutions en HUF (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 509 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 3 701 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1 029 911) |
| | S/O | (1 025 701) |
| Institutions en ILS (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (531) |
| | S/O | (531) |
| Institutions en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 386 | 146 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (308) | (898) |
| | 78 | (752) |
| Institutions en PLN (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (11 435) |
| | S/O | (11 435) |
| Institutions en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 13 501 | 1 808 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 706) | (37 339) |
| | 7 795 | (35 531) |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 10 377 | 938 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (884) | (396) |
| | 9 494 | 542 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 10 514 | 24 529 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (16 970) | (43 856) |
| | (6 456) | (19 327) |
| Distribution | | |
| Émises | 4 619 | 7 701 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 20 | 18 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 216) | (2 854) |
| | 423 | 4 865 |
| Investisseurs en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 49 | 824 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (344) | (133) |
| | (295) | 691 |
| Investisseurs en CAD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (175) |
| | S/O | (175) |
| Investisseurs en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 | 11 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (63) | (94) |
| | (59) | (83) |
| Distribution | | |
| Émises | 39 | 16 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (156) | (145) |
| | (117) | (129) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 956 | 672 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (759) | (1 603) |
| | 197 | (931) |
| Distribution | | |
| Émises | 34 | 18 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (172) | (218) |
| | (135) | (198) |
| Investisseurs en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 7 | 17 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17) | (61) |
| | (10) | (44) |
| Investisseurs en RMB (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (30) |
| | S/O | (30) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
| Investisseurs en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 176 | 288 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (226) | (151) |
| | (50) | 137 |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 260 | 272 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (998) | (6 285) |
| | 262 | (6 013) |
| Distribution | | |
| Émises | 3 001 | 651 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 9 | 9 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 235) | (3 753) |
| | 1 775 | (3 093) |
| Administrations en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (27) | (13) |
| | (24) | (13) |
| Administrations en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 490 | 215 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (361) | (235) |
| | 129 | (20) |
| Distribution | | |
| Émises | 269 | 220 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (177) | (180) |
| | 92 | 40 |
| Administrations en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 199 | 71 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10) | (176) |
| | 190 | (104) |
| Administrations en HKD (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 2 789 | 4 427 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (4 427) |
| | 2 789 | 0 |
| Administrations en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 64 371 | 72 625 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (147 507) | (59 977) |
| | (83 136) | 12 648 |
| Administrations en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 998 | 9 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (76) | (197) |
| | 1 922 | (188) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
| BM Détail : | | |
| Décumulation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 13 621 | 9 251 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 666) | (13 142) |
| | 3 955 | (3 891) |
| Distribution | | |
| Émises | 10 825 | 5 108 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 69 | 73 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 159) | (10 629) |
| | 1 735 | (5 448) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 187 | 265 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (743) | (1 399) |
| | (556) | (1 134) |
| Catégorie E en EUR (exposition au risque de change) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (140) |
| | 0 | (140) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 14 345 | 12 147 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (22 720) | (16 618) |
| | (8 375) | (4 471) |
| Distribution | | |
| Émises | 945 | 946 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 371) | (3 458) |
| | (1 425) | (2 511) |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 336 | 134 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (425) | (535) |
| | (86) | (398) |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 2 589 | 862 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 14 | 4 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (723) | (875) |
| | 1 880 | (9) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 37 906 | 21 140 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (29 500) | (13 895) |
| | 8 406 | 7 245 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
| Distribution | | |
| Émises | 720 | 1 741 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 36 | 33 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (766) | (1 125) |
| | (10) | 649 |
| H Institutions (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 38 276 | 22 933 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (51 448) | (84) |
| | (13 172) | 22 849 |
| M Détail : | | |
| Décumulation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 724 | 326 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (475) | (2 065) |
| | 252 | (1 737) |
| Distribution II | | |
| Émises | 10 209 | 5 726 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10 336) | (7 045) |
| | (125) | (1 318) |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 116 | 103 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (87) | 0 |
| | 29 | 103 |
| Catégorie R : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 29 | 143 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (534) | (790) |
| | (505) | (647) |
| Distribution | | |
| Émises | 92 | 30 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (149) | (122) |
| | (56) | (92) |
| Catégorie R en EUR (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 3 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (86) | (275) |
| | (86) | (272) |
| Catégorie R en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 170 | 285 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (450) | (428) |
| | (280) | (143) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
| Catégorie T : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 396 | 333 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (807) | (985) |
| | (411) | (652) |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 234 | 58 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (160) | (111) |
| | 74 | (53) |
| Catégorie W : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 701 | 802 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 903) | (3 534) |
| | 798 | (2 732) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 506 | 600 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (522) | (1 279) |
| | 984 | (679) |
| Catégorie W en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 301 | 55 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (379) | (893) |
| | (78) | (838) |
| Catégorie W en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 164 | 3 284 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 172) | (16 428) |
| | (8) | (13 144) |
| Distribution | | |
| Émises | 454 | 32 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (47) | (116) |
| | 407 | (84) |
| Catégorie W en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 193 | 378 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (182) | (44) |
| | 11 | 334 |
| Distribution | | |
| Émises | 848 | 94 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (133) | (881) |
| | 715 | (787) |
| Catégorie W en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 282 | 561 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (65) | (81) |
| | 1 217 | 480 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 995 | 3 548 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 224) | (835) |
| | (229) | 2 713 |
| Distribution | | |
| Émises | 13 051 | 582 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 188) | (1 240) |
| | 11 865 | (658) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 323 | 5 476 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 109) | (1 599) |
| | (786) | 3 877 |
| Distribution | | |
| Émises | 130 | 3 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9) | (54) |
| | 121 | (51) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 37 792 | 15 414 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 755) | (12 338) |
| | 30 037 | 3 076 |
| Distribution | | |
| Émises | 7 132 | 46 158 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 40 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17 617) | (10 802) |
| | (10 485) | 35 396 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 418 | 2 854 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 761) | (2 656) |
| | (4 343) | 198 |
| Distribution | | |
| Émises | 20 237 | 452 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (564) | (5 089) |
| | 19 673 | (4 637) |
| Institutions en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 292 | 106 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (99) | 0 |
| | 193 | 106 |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 11 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (11) | 0 |
| | (11) | 11 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite) | | |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Administrations en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 26 799 | 30 800 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (11 000) | (17 723) |
| | 15 799 | 13 077 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 913 | 44 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (27) | (216) |
| | 886 | (172) |
| Distribution | | |
| Émises | 374 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8) | (29) |
| | 366 | (29) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 | 47 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17) | (6) |
| | (12) | 41 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 0 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 233 | 60 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 733) | (363) |
| | 1 500 | (303) |
| Distribution | | |
| Émises | 38 | 13 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (33) | (29) |
| | 5 | (16) |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 26 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 26 | 0 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite) | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (10) |
| | S/O | (10) |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 148 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 700) | 0 |
| | (1 552) | 0 |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 807 | 17 233 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 582) | (18 259) |
| | (6 775) | (1 026) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 137 | 282 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 693) | (1 169) |
| | 1 444 | (887) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 792 | 37 827 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (25 072) | (38 154) |
| | (23 280) | (327) |
| Distribution | | |
| Émises | 9 | 67 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 117) | (841) |
| | (1 108) | (774) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 940 | 3 306 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 058) | (3 949) |
| | (2 118) | (643) |
| Distribution | | |
| Émises | 3 915 | 3 506 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 437) | (2 465) |
| | 479 | 1 041 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 23 484 | 34 943 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 23 484 | 34 943 |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 344 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (227) | (196) |
| | (227) | 148 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite) | | |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 354 | 2 786 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 415) | (1 966) |
| | (1 061) | 820 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 544 | 10 191 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 064) | (7 015) |
| | (6 520) | 3 176 |
| Fonds Global Real Return Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 223 | 4 831 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 194) | (6 987) |
| | 29 | (2 156) |
| Distribution | | |
| Émises | 151 | 129 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 5 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (576) | (474) |
| | (423) | (340) |
| Institutions (exposition au risque de change) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 33 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (102) | (715) |
| | (69) | (715) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 833 | 761 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 127) | (401) |
| | (294) | 360 |
| Distribution | | |
| Émises | 119 | 634 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (769) | (174) |
| | (650) | 460 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 8 162 | 19 760 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17 902) | (22 869) |
| | (9 740) | (3 109) |
| Distribution | | |
| Émises | 196 | 400 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 95 | 187 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 351) | (1 252) |
| | (1 060) | (665) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 604 | 1 338 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 113) | (1 217) |
| | (509) | 121 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Real Return Fund (suite) | | |
| Distribution | | |
| Émises | 7 497 | 5 537 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 36 | 49 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 732) | (6 352) |
| | (2 199) | (766) |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 61 | 152 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (140) | (1 418) |
| | (79) | (1 266) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 73 | 900 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 668) | (1 580) |
| | (1 595) | (680) |
| Distribution | | |
| Émises | 234 | 2 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 25 | 43 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (30) | (1 171) |
| | 229 | (1 126) |
| Investisseurs en CHF (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 7 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (80) | (135) |
| | (80) | (128) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 83 | 84 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (270) | (489) |
| | (187) | (405) |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 42 | 382 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (460) | (1 192) |
| | (418) | (810) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 272 | 3 430 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 092) | (5 529) |
| | (1 820) | (2 099) |
| Distribution | | |
| Émises | 166 | 1 089 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 19 | 57 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (988) | (1 375) |
| | (803) | (229) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 851 | 3 812 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 233) | (5 495) |
| | (1 382) | (1 683) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Global Real Return Fund (suite) | | |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 53 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (336) |
| | S/O | (282) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 138 | 2 482 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (806) | (4 207) |
| | 2 332 | (1 725) |
| Catégorie R : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 11 | 13 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (70) | (395) |
| | (59) | (382) |
| Catégorie R en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 62 | 178 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (226) | (375) |
| | (164) | (197) |
| Fonds Income Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 235 764 | 205 515 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (183 589) | (266 612) |
| | 52 175 | (61 097) |
| Distribution | | |
| Émises | 140 047 | 134 393 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 778 | 2 459 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (113 756) | (143 512) |
| | 29 069 | (6 660) |
| Institutions en AUD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 483 | 200 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (230) | (918) |
| | 1 253 | (718) |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 123 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (124) |
| | S/O | (1) |
| Distribution | | |
| Émises | 24 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 24 | S/O |
| Institutions en BRL (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 336 | 1 312 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 695) | (24 928) |
| | 641 | (23 616) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Income Fund (suite) | | |
| Institutions en CAD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 075 | 352 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (688) | (937) |
| | 387 | (585) |
| Distribution | | |
| Émises | 739 | 95 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 9 | 7 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (416) | (492) |
| | 332 | (390) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 8 128 | 4 888 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 506) | (4 933) |
| | 1 622 | (45) |
| Distribution | | |
| Émises | 6 370 | 2 143 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 083) | (4 171) |
| | 3 287 | (2 028) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 237 892 | 305 996 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (223 868) | (373 923) |
| | 14 024 | (67 927) |
| Distribution | | |
| Émises | 21 017 | 28 529 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 31 | 264 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (27 440) | (49 457) |
| | (6 392) | (20 664) |
| Distribution II | | |
| Émises | 1 623 | 768 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (558) | (1 351) |
| | 1 065 | (583) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 7 842 | 2 926 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 816) | (5 345) |
| | 5 026 | (2 419) |
| Distribution | | |
| Émises | 27 957 | 8 905 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 37 | 38 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (12 646) | (5 318) |
| | 15 348 | 3 625 |
| Institutions en HKD (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 19 180 | 7 384 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 28 | 17 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (35 150) | (33 765) |
| | (15 942) | (26 364) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------|---------------------|
| | Fonds Income Fund (suite) | |
| Institutions en JPY (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 123 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (352) |
| | S/O | (229) |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 007 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (910) | S/O |
| | 2 097 | S/O |
| Institutions en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 788 | 4 029 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 084) | (2 602) |
| | 704 | 1 427 |
| Institutions en RMB (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 080 | 3 501 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 560) | (2 109) |
| | 3 520 | 1 392 |
| Distribution | | |
| Émises | 27 618 | 7 373 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 150 | 65 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 147) | (8 523) |
| | 18 621 | (1 085) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 33 434 | 21 157 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (40 309) | (74 160) |
| | (6 875) | (53 003) |
| Distribution | | |
| Émises | 41 977 | 36 086 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 169 | 161 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (41 974) | (44 046) |
| | 172 | (7 799) |
| Investisseurs en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 2 862 | 1 063 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (542) | (1 007) |
| | 2 320 | 56 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------|---------------------|
| | Fonds Income Fund (suite) | |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 21 322 | 57 324 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (21 229) | (79 974) |
| | 93 | (22 650) |
| Distribution | | |
| Émises | 3 417 | 1 522 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 985) | (3 390) |
| | 1 432 | (1 868) |
| Distribution A | | |
| Émises | 150 | 161 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (754) | (540) |
| | (604) | (379) |
| Investisseurs en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 234 | 1 302 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (82) | (272) |
| | 152 | 1 030 |
| Investisseurs en HKD (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 8 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 8 | S/O |
| Investisseurs en JPY (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Investisseurs en RMB (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 428 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (136) | (415) |
| | 292 | (415) |
| Investisseurs en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 031 | 508 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (68) |
| | 1 031 | 440 |
| Distribution | | |
| Émises | 3 988 | 2 208 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 4 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 521) | (3 473) |
| | 2 471 | (1 265) |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 26 278 | 8 620 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17 485) | (16 949) |
| | 8 793 | (8 329) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------|---------------------|
| | Fonds Income Fund (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | 105 546 | 66 046 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 550 | 410 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (47 552) | (96 953) |
| | 58 544 | (30 497) |
| Administrations en AUD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 15 948 | 5 920 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 118 | 74 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 454) | (4 398) |
| | 13 612 | 1 596 |
| Administrations en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 5 959 | 16 413 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 365) | (23 680) |
| | (1 406) | (7 267) |
| Distribution | | |
| Émises | 10 041 | 9 626 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 650) | (9 123) |
| | 5 392 | 503 |
| Administrations en GBP (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 4 526 | 2 145 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 78 | 58 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 096) | (3 252) |
| | 3 508 | (1 049) |
| Administrations en HKD (non couverte) : Distribution | | |
| Émises | 193 297 | 102 825 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 153 | 36 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (49 337) | (201 758) |
| | 144 113 | (98 897) |
| Administrations en JPY (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 713 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (714) |
| | S/O | (1) |
| Administrations en SGD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 98 323 | 19 561 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 577 | 312 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (11 233) | (16 816) |
| | 87 667 | 3 057 |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 119 582 | 72 634 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (82 321) | (124 100) |
| | 37 261 | (51 466) |
| Distribution | | |
| Émises | 326 240 | 129 484 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 985 | 2 095 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (140 923) | (212 567) |
| | 188 302 | (80 988) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------|---------------------|
| | Fonds Income Fund (suite) | |
| Distribution Q | | |
| Émises | S/O | 142 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (345) |
| | S/O | (203) |
| Catégorie E en AUD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 31 546 | 9 508 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 578 | 317 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 850) | (10 371) |
| | 25 274 | (546) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 1 042 | 659 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 353) | (1 563) |
| | (1 311) | (904) |
| Distribution | | |
| Émises | 24 880 | 2 434 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 4 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 889) | (4 987) |
| | 22 995 | (2 553) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 108 725 | 69 869 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (81 381) | (84 120) |
| | 27 344 | (14 251) |
| Distribution | | |
| Émises | 97 760 | 58 606 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 134 | 67 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (89 926) | (90 970) |
| | 7 968 | (32 297) |
| Distribution II | | |
| Émises | 6 406 | 3 524 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 361) | (2 127) |
| | 4 046 | 1 397 |
| Distribution II Q | | |
| Émises | 822 | 911 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 445) | (1 774) |
| | (623) | (863) |
| Catégorie E en GBP (couverte) : Distribution | | |
| Émises | 8 061 | 5 514 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 74 | 46 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 197) | (4 932) |
| | 2 938 | 628 |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : Distribution | | |
| Émises | 169 278 | 68 787 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 356 | 267 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (100 430) | (142 484) |
| | 69 204 | (73 430) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------|---------------------|
| | Fonds Income Fund (suite) | |
| Catégorie E en JPY (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 10 306 | 3 694 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 121) | (138) |
| | 7 185 | 3 556 |
| Distribution | | |
| Émises | 57 336 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 281 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 275) | 0 |
| | 55 342 | 1 |
| Catégorie E en RMB (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 5 508 | 842 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 54 | 26 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (821) | (1 768) |
| | 4 741 | (900) |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 306 460 | 71 590 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 526 | 1 221 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (50 032) | (58 744) |
| | 258 954 | 14 067 |
| G Détail en EUR (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 8 744 | 291 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (508) | (1 161) |
| | 8 236 | (870) |
| G Détail en EUR (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 5 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (56) |
| | S/O | (51) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 33 408 | 21 920 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17 389) | (25 642) |
| | 16 019 | (3 722) |
| Distribution | | |
| Émises | 22 995 | 8 454 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 788 | 625 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 594) | (9 681) |
| | 17 189 | (602) |
| H Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 144 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (916) |
| | S/O | (772) |
| Catégorie R : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 981 | 2 924 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 345) | (1 290) |
| | 636 | 1 634 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------------|---------------------|
| | Fonds Income Fund (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 425 | 491 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 18 | 33 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 462) | (1 911) |
| | (19) | (1 387) |
| Catégorie R en EUR (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 341 | 215 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (400) | (327) |
| | (56) | (111) |
| Catégorie R en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 067 | 925 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (582) | (1 828) |
| | 486 | (903) |
| Catégorie T : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 702 | 3 483 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 951) | (7 146) |
| | (249) | (3 663) |
| Distribution | | |
| Émises | 2 962 | 745 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 144 | 119 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 622) | (2 127) |
| | 1 484 | (1 263) |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 898 | 2 767 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 463) | (4 018) |
| | 1 435 | (1 251) |
| Distribution | | |
| Émises | 5 296 | 2 094 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 815) | (4 633) |
| | 1 481 | (2 539) |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 4 085 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 662) | 0 |
| | (2 662) | 4 085 |
| Catégorie Z en AUD (couverte) : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 13 344 | 17 238 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 8 510 | 6 580 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (23 545) | (16 520) |
| | (1 691) | 7 298 |
| Fonds Income Fund II | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 0 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|----------------------------------|---------------------|
| | Fonds Income Fund II (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (1) |
| | S/O | (1) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Catégorie E : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 6 709 | 2 007 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 648) | (113) |
| | 3 061 | 1 895 |
| Catégorie E en AUD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 2 670 | 210 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 350) | 0 |
| | 1 322 | 212 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 655 | 362 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (383) | (28) |
| | 273 | 335 |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 660 | 332 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (594) | (24) |
| | 1 067 | 309 |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 33 686 | 8 423 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 11 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (19 174) | (1 455) |
| | 14 513 | 6 979 |
| Catégorie E en JPY (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 38 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 38 | S/O |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 3 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (38) |
| | S/O | (34) |
| | | |
| | Fonds Inflation Multi-Asset Fund | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 659 | 3 039 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (716) | (1 334) |
| | (57) | 1 705 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--|---------------------|
| | Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite) | |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 48 | 11 234 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 864) | (2 993) |
| | (5 816) | 8 241 |
| Institutions en GBP (partiellement couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 155 | 2 046 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (197) | (3 662) |
| | (42) | (1 616) |
| Administrations : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 0 | 334 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 7 | 5 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (122) | (1) |
| | (115) | 338 |
| Administrations en SGD (couverte) : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 38 | 3 086 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 12 | 28 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (662) | (1 917) |
| | (612) | 1 197 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 512 | 10 246 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 917) | (2 978) |
| | (4 405) | 7 268 |
| Distribution II | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Catégorie E en AUD (partiellement couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 36 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 36 |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 190 | 12 001 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 353) | (3 471) |
| | (5 163) | 8 530 |
| Distribution | | |
| Émises | 89 | 1 435 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (568) | (731) |
| | (479) | 704 |
| Catégorie E en GBP (partiellement couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite) | | |
| Catégorie E en SGD (partiellement couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| M Détail : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 22 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 22 | 1 |
| Fonds Low Average Duration Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 685 | 17 557 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (12 944) | (22 086) |
| | (9 259) | (4 529) |
| Distribution | | |
| Émises | 52 | 3 385 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 48 | 24 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 127) | (1 191) |
| | (2 027) | 2 218 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 112 | 3 251 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 638) | (2 789) |
| | (1 526) | 462 |
| Distribution | | |
| Émises | 269 | 416 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 066) | (449) |
| | (796) | (32) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 158 | 534 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 176) | (133) |
| | (18) | 401 |
| Distribution | | |
| Émises | 7 | 11 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 4 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (114) | (85) |
| | (103) | (72) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 31 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (459) | (229) |
| | (428) | (228) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Low Average Duration Fund (suite) | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 33 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (61) | (590) |
| | (60) | (556) |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 43 | 203 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (211) | (181) |
| | (168) | 22 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 562 | 9 196 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 521) | (9 321) |
| | (959) | (125) |
| Distribution | | |
| Émises | 48 | 60 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (185) | (154) |
| | (135) | (93) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 576 | 1 475 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 848) | (446) |
| | (1 272) | 1 029 |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 11 786 | 77 194 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (18 432) | (76 411) |
| | (6 646) | 783 |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | 97 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (32) | (686) |
| | (28) | (586) |
| Catégorie R : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 91 | 250 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (308) | (228) |
| | (217) | 22 |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 14 773 | 8 468 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 098) | (5 711) |
| | 10 675 | 2 757 |
| Distribution | | |
| Émises | 75 | 1 830 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 39 | 28 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (109) | 0 |
| | 5 | 1 858 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 14 067 | 3 012 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 709) | (9 445) |
| | 10 358 | (6 433) |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 2 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6) | (82) |
| | (6) | (80) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 280 | 263 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (535) | (166) |
| | (255) | 97 |
| Distribution | | |
| Émises | 15 | 153 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (43) | (1 570) |
| | (28) | (1 417) |
| Institutions en NOK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 99 | 1 345 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 404) | (3 883) |
| | (1 305) | (2 538) |
| Institutions en SEK (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 016 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 3 016 | S/O |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 533 | 1 820 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 518) | (771) |
| | 15 | 1 049 |
| Fonds Low Duration Income Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 8 543 | 17 232 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 740) | (24 502) |
| | 2 803 | (7 270) |
| Distribution | | |
| Émises | 30 340 | 401 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 2 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (815) | (479) |
| | 29 527 | (76) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 16 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (194) |
| | S/O | (178) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds Low Duration Income Fund (suite) | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 5 917 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 5 917 | S/O |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 8 107 | 7 973 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 903) | (7 357) |
| | 4 204 | 616 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 5 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (6 040) |
| | 0 | (6 035) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 19 164 | 10 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (165) | (169) |
| | 18 999 | (159) |
| Distribution | | |
| Émises | 13 462 | 51 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 296) | (7 884) |
| | 7 166 | (7 833) |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 108 | 836 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 885) | (1 153) |
| | 223 | (317) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (61) |
| | S/O | (61) |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (48) |
| | S/O | (48) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 023 | 9 022 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 594) | (7 895) |
| | 2 429 | 1 127 |
| Distribution | | |
| Émises | 248 | 496 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 9 | 4 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (340) | (519) |
| | (83) | (19) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Low Duration Income Fund (suite) | | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 7 759 | 5 036 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 485) | (3 364) |
| | 5 274 | 1 672 |
| Distribution | | |
| Émises | 973 | 291 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (107) | (78) |
| | 866 | 213 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : Distribution | | |
| Émises | S/O | 4 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (78) |
| | S/O | (73) |
| H Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 914 | 14 535 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 463) | (8 743) |
| | (4 549) | 5 792 |
| Distribution | | |
| Émises | 322 | 164 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (45) | (119) |
| | 279 | 45 |
| Catégorie Z en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1) | 0 |
| | (1) | 0 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 9 801 | 15 819 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 363) | (22 277) |
| | 2 438 | (6 458) |
| Distribution | | |
| Émises | 2 | 9 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (938) | (505) |
| | (936) | (496) |
| Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 109 | 1 940 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (950) | (3 402) |
| | (841) | (1 462) |
| Distribution | | |
| Émises | 18 | 1 502 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 3 | 10 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 240) | (1 565) |
| | (1 219) | (53) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite) | | |
| Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 951 | 39 578 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (48 798) | (125 565) |
| | (47 847) | (85 987) |
| Distribution | | |
| Émises | 17 378 | 7 687 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 197 | 71 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (21 050) | (20 525) |
| | (3 475) | (12 767) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 7 | 15 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (176) | (336) |
| | (169) | (321) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 51 | 67 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (94) | (160) |
| | (43) | (93) |
| Catégorie Z : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (165) | (135) |
| | (165) | (135) |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 446 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 1 | 446 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 23 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 23 |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 20 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 20 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Low Duration Opportunites ESG Fund (suite) | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 27 | 1 904 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (947) | (2 448) |
| | (920) | (544) |
| Distribution | | |
| Émises | 5 | 81 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (409) | (4 100) |
| | (404) | (4 019) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 527 | 3 125 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 461) | (995) |
| | (934) | 2 130 |
| Distribution | | |
| Émises | 17 | 351 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (327) | (181) |
| | (310) | 170 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (20) | (31) |
| | (19) | (31) |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (5) |
| | S/O | (5) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (117) |
| | S/O | (117) |
| Catégorie E : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 116 | 5 241 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 046) | (3 306) |
| | (929) | 1 936 |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (439) | 0 |
| | (439) | 0 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Mortgage Opportunites Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 16 015 | 25 921 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17 693) | (35 398) |
| | (1 678) | (9 477) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 398 | 1 777 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 15 | 447 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 116) | (26 696) |
| | (6 703) | (24 472) |
| Institutions en CAD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 674 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 1 674 | 0 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 87 | 53 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (134) | (263) |
| | (47) | (210) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 16 534 | 12 444 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (11 638) | (22 004) |
| | 4 896 | (9 560) |
| Distribution | | |
| Émises | 278 | 134 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 32 | 43 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (981) | (1 207) |
| | (671) | (1 030) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 147 | 35 235 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (425) | (36 241) |
| | (278) | (1 006) |
| Distribution | | |
| Émises | 922 | 615 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (373) | (484) |
| | 549 | 131 |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 455 | 155 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (614) | (1 077) |
| | (159) | (922) |
| Distribution | | |
| Émises | 169 | 29 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (48) | (1 403) |
| | 123 | (1 371) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite) | | |
| Administrations : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 623 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (628) | (49) |
| | (5) | (49) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 708 | 1 235 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 527) | (2 163) |
| | 1 181 | (928) |
| Distribution | | |
| Émises | 853 | 51 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 5 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (83) | (575) |
| | 775 | (521) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 10 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (32) | (14) |
| | (22) | (14) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 408 | 270 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (741) | (446) |
| | (333) | (176) |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (17) |
| | S/O | (17) |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (169) |
| | S/O | (168) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 298 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7) | (3) |
| | 291 | (3) |
| Distribution | | |
| Émises | 90 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 91 | S/O |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 496 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | (19 628) |
| | 1 496 | (19 627) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite) | | |
| Catégorie Z en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (34 658) |
| | S/O | (34 658) |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 16 148 | 7 763 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 962) | (34 505) |
| | 10 186 | (26 742) |
| Distribution | | |
| Émises | 122 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 27 | 6 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (72) | (186) |
| | 77 | (179) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 742 | 5 360 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 545) | (16 644) |
| | (803) | (11 284) |
| Distribution | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (68) |
| | S/O | (68) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 25 | 461 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (481) | (23) |
| | (456) | 438 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 23 | 41 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (61) | (3) |
| | (38) | 38 |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 198 | 260 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (162) | (191) |
| | 36 | 69 |
| BE Détail : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 475 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (888) | 0 |
| | 587 | 1 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 399 | 1 702 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 261) | (970) |
| | 138 | 732 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds StocksPLUS™ Fund (suite) | | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 883 | 4 253 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 338) | (2 398) |
| | 3 545 | 1 855 |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 24 409 | 16 223 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (21 621) | (46 974) |
| | 2 788 | (30 751) |
| Catégorie T : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (124) |
| | S/O | (124) |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 75 | 89 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (113) | (29) |
| | (38) | 60 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 2 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (26) |
| | S/O | (24) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 59 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (78) | 0 |
| | (19) | 1 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (2) |
| | S/O | (2) |
| Fonds Strategic Income Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 16 | 74 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (299) | (889) |
| | (283) | (815) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 029 | 5 539 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 683) | (7 311) |
| | (2 654) | (1 772) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds Strategic Income Fund (suite) | | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 0 | 21 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 1 | 21 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 280 | 1 152 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (752) | (875) |
| | (472) | 277 |
| Distribution II | | |
| Émises | 244 | 760 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (396) | (600) |
| | (151) | 161 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 592 | 4 473 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 080) | (3 943) |
| | (2 488) | 530 |
| Distribution II | | |
| Émises | 668 | 1 437 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 000) | (2 014) |
| | (1 332) | (577) |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 59 | 210 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (325) | (264) |
| | (266) | (54) |
| Distribution | | |
| Émises | 122 | 217 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (241) | (126) |
| | (119) | 91 |
| Fonds Total Return Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 14 082 | 14 515 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10 612) | (12 236) |
| | 3 470 | 2 279 |
| Distribution | | |
| Émises | 2 187 | 1 043 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 181 | 144 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 719) | (3 382) |
| | 649 | (2 195) |
| Institutions en CAD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 347 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 8 | 7 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (494) | (960) |
| | (139) | (953) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--------------------------------------|---------------------|
| | Fonds Total Return Bond Fund (suite) | |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 348 | 110 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (60) | (901) |
| | 288 | (791) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 8 679 | 11 822 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 151) | (7 110) |
| | (472) | 4 712 |
| Distribution | | |
| Émises | 317 | 214 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 557 | 398 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (692) | (423) |
| | 182 | 189 |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 24 | 1 047 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (491) | (799) |
| | (467) | 248 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 521 | 89 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (212) | (172) |
| | 309 | (83) |
| Distribution | | |
| Émises | 750 | 1 008 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 21 | 20 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 967) | (1 840) |
| | (1 196) | (812) |
| Institutions en ILS (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (13) |
| | S/O | (13) |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 79 | 425 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (113) | (1 297) |
| | (34) | (872) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 154 | 6 860 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 043) | (3 170) |
| | (2 889) | 3 690 |
| Distribution | | |
| Émises | 411 | 4 075 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 7 | 6 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 658) | (1 523) |
| | (1 240) | 2 558 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--------------------------------------|---------------------|
| | Fonds Total Return Bond Fund (suite) | |
| Investisseurs en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 62 | 28 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (123) | (138) |
| | (61) | (110) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 86 | 441 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (215) | (277) |
| | (129) | 164 |
| Administrations : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 541 | 1 321 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (886) | (1 487) |
| | (345) | (166) |
| Distribution | | |
| Émises | 4 905 | 2 212 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (124) | (1 730) |
| | 4 781 | 482 |
| Administrations en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 9 | 154 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (36) | (29) |
| | (27) | 125 |
| Administrations en SGD (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 1 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | S/O |
| | 1 | S/O |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 590 | 2 883 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 323) | (3 718) |
| | 267 | (835) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 023 | 1 010 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 44 | 33 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 492) | (2 318) |
| | (1 425) | (1 275) |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 508 | 744 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (424) | (131) |
| | 84 | 613 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 737 | 2 661 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (4 728) | (5 090) |
| | (2 991) | (2 429) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--------------------------------------|---------------------|
| | Fonds Total Return Bond Fund (suite) | |
| Distribution | | |
| Émises | 191 | 431 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (925) | (909) |
| | (734) | (478) |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 21 | 19 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (72) | (35) |
| | (51) | (16) |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 10 | 82 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (165) | (186) |
| | (155) | (104) |
| Catégorie E en SGD (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 221 | 97 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (175) | (163) |
| | 46 | (66) |
| H Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 4 562 | 8 179 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 035) | (10 096) |
| | 2 527 | (1 917) |
| Distribution | | |
| Émises | 344 | 182 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 12 | 9 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (173) | (822) |
| | 183 | (631) |
| M Détail en HKD (non couverte) : Distribution | | |
| Émises | 658 | 99 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10) | (29) |
| | 648 | 70 |
| Catégorie R en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 3 | 128 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (75) | (355) |
| | (72) | (227) |
| Catégorie T : Capitalisation | | |
| Émises | 22 | 96 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (107) | (616) |
| | (85) | (520) |
| Catégorie T en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 121 | 200 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (90) | (119) |
| | 31 | 81 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|--|---------------------|
| | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | |
| Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 3 086 | 12 457 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (9 946) | (4 248) |
| | (6 860) | 8 209 |
| Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 393 | 10 855 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (10 603) | (1 198) |
| | (10 210) | 9 657 |
| Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 31 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6) | 0 |
| | 25 | 1 |
| Distribution | | |
| Émises | 5 546 | 3 333 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 502) | 0 |
| | 2 045 | 3 333 |
| Investisseurs : Capitalisation | | |
| Émises | 556 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (34) | 0 |
| | 522 | 1 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 1 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 1 |
| Catégorie E : Capitalisation | | |
| Émises | 719 | 3 403 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (582) | (2 731) |
| | 137 | 672 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation | | |
| Émises | 402 | 1 900 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (777) | (402) |
| | (375) | 1 498 |
| H Institutions : Capitalisation | | |
| Émises | 100 | 4 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (14) | 0 |
| | 86 | 4 |
| Catégorie Z : Capitalisation | | |
| Émises | 474 | 3 659 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (898) | 0 |
| | (424) | 3 659 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds UK Corporate Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 400 | 653 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (722) | (1 469) |
| | (322) | (816) |
| Distribution | | |
| Émises | 8 171 | 8 201 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (13 386) | (16 638) |
| | (5 215) | (8 437) |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 0 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 0 | 0 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 351 | 5 022 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 486) | (3 722) |
| | (1 135) | 1 300 |
| Distribution | | |
| Émises | 80 | 183 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (508) | (105) |
| | (428) | 78 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 581 | 4 125 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (7 506) | (23 143) |
| | (4 925) | (19 018) |
| Distribution | | |
| Émises | 1 626 | 1 227 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 127 | 158 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 453) | (13 176) |
| | (3 700) | (11 791) |
| Institutions en CHF (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 22 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (244) |
| | S/O | (222) |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 1 357 | 2 175 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 883) | (8 534) |
| | (1 526) | (6 359) |
| Distribution | | |
| Émises | 122 | 669 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 138 | 303 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 636) | (9 203) |
| | (1 376) | (8 231) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds US High Yield Bond Fund (suite) | | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 288 | 196 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (907) | (292) |
| | (619) | (96) |
| Distribution | | |
| Émises | 213 | 63 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (82) | (447) |
| | 131 | (384) |
| Institutions en SGD (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | S/O | 15 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | S/O | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | S/O | (52) |
| | S/O | (37) |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 582 | 485 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 306) | (4 966) |
| | (724) | (4 481) |
| Distribution | | |
| Émises | 135 | 448 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 21 | 31 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (873) | (1 987) |
| | (717) | (1 508) |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 14 | 495 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (20) | (495) |
| | (6) | 0 |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 658 | 853 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 163) | (2 926) |
| | (505) | (2 073) |
| Distribution | | |
| Émises | 6 012 | 5 181 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 79 | 70 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 501) | (10 275) |
| | 590 | (5 024) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 169 | 1 163 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (607) | (1 564) |
| | (438) | (401) |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 014 | 6 232 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 636) | (7 216) |
| | 378 | (984) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|---|---------------------|---------------------|
| Fonds US High Yield Bond Fund (suite) | | |
| Distribution | | |
| Émises | 342 | 31 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (17) | (70) |
| | 326 | (38) |
| M Détail : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 6 557 | 12 039 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 222) | (11 070) |
| | 336 | 970 |
| Catégorie R : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 4 | 319 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (133) | (236) |
| | (129) | 83 |
| Catégorie Z : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 218 | 0 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | 0 | 0 |
| | 218 | 0 |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 12 595 | 10 490 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6 673) | (6 644) |
| | 5 922 | 3 846 |
| Distribution | | |
| Émises | 3 527 | 2 630 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 5 | 3 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (3 341) | (1 431) |
| | 191 | 1 202 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 845 | 6 790 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (8 104) | (12 251) |
| | (5 259) | (5 461) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Distribution II | | |
| Émises | 3 019 | 840 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 283 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 337) | (30 818) |
| | 1 683 | (29 695) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 380 | 1 086 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (641) | (249) |
| | 2 739 | 837 |
| Distribution | | |
| Émises | 313 | 111 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | 1 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (46) | (279) |
| | 268 | (167) |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 |
|--|---------------------|---------------------|
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite) | | |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 204 | 6 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (6) | 0 |
| | 198 | 6 |
| Fonds US Short-Term Fund | | |
| Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 20 663 | 73 837 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (49 119) | (71 198) |
| | (28 456) | 2 639 |
| Distribution | | |
| Émises | 330 | 3 299 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 235) | (264) |
| | (905) | 3 035 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 3 114 | 16 072 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (16 925) | (18 694) |
| | (13 811) | (2 622) |
| Institutions en GBP (couverte) : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 22 | S/O |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 1 | S/O |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2) | S/O |
| | 21 | S/O |
| Investisseurs : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 310 | 174 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (841) | (681) |
| | (531) | (507) |
| Catégorie E : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 20 879 | 15 967 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (22 829) | (20 780) |
| | (1 950) | (4 813) |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 2 965 | 4 393 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (5 797) | (681) |
| | (2 832) | 3 712 |
| H Institutions : | | |
| Capitalisation | | |
| Émises | 517 | 840 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 0 | 0 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (1 030) | (1 943) |
| | (513) | (1 103) |
| Catégorie Z : | | |
| Distribution | | |
| Émises | 500 | 690 |
| Émises à partir du réinvestissement des distributions | 2 896 | 1 338 |
| Rachetées au cours de l'exercice | (2 172) | (32 194) |
| | 1 224 | (30 166) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

19. VALEURS NETTES D'INVENTAIRE

L'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables, les actions émises en circulation, ainsi que la Valeur Nette d'Inventaire par action de chacun des Fonds pour les trois derniers exercices sont les suivants (les montants sont en milliers, sauf les montants par action). La VNI par action publiée dans ces états financiers peut comporter des ajustements requis en vertu de la norme FRS 102, qui peuvent donner lieu à des écarts entre les VNI ou le total des rendements des actionnaires et ceux indiqués dans ces états financiers. L'actif net divisé par le nombre d'Actions émises et en circulation peut ne pas être égal à la VNI par action en raison des arrondis :

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|----------------------------------|---------------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | | | | |
| Actifs nets | \$ | 2 434 728 | \$ | 2 981 392 | \$ | 3 411 923 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 1 472 296 | \$ | 1 552 047 | \$ | 1 221 240 |
| Actions émises en circulation | | 164 619 | | 174 453 | | 117 953 |
| VNI par action | \$ | 8,94 | \$ | 8,90 | \$ | 10,35 |
| Distribution | \$ | 125 117 | \$ | 113 734 | \$ | 248 734 |
| Actions émises en circulation | | 19 073 | | 16 032 | | 28 125 |
| VNI par action | \$ | 6,56 | \$ | 7,09 | \$ | 8,84 |
| Institutions en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 128 | AUD | 203 422 | AUD | 12 |
| Actions émises en circulation | | 20 | | 28 372 | | 1 |
| VNI par action | AUD | 6,50 | AUD | 7,17 | AUD | 9,00 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 2 735 | CHF | 4 094 | CHF | 35 166 |
| Actions émises en circulation | | 365 | | 527 | | 3 797 |
| VNI par action | CHF | 7,49 | CHF | 7,77 | CHF | 9,26 |
| Distribution | CHF | 1 582 | CHF | 1 912 | CHF | 5 135 |
| Actions émises en circulation | | 262 | | 281 | | 591 |
| VNI par action | CHF | 6,04 | CHF | 6,81 | CHF | 8,69 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 275 717 | € | 498 977 | € | 653 189 |
| Actions émises en circulation | | 35 835 | | 63 739 | | 70 200 |
| VNI par action | € | 7,69 | € | 7,83 | € | 9,30 |
| Distribution | € | 20 415 | € | 27 728 | € | 75 650 |
| Actions émises en circulation | | 3 301 | | 4 056 | | 8 695 |
| VNI par action | € | 6,18 | € | 6,84 | € | 8,70 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 13 169 | £ | 14 369 | £ | 18 246 |
| Actions émises en circulation | | 1 685 | | 1 836 | | 1 996 |
| VNI par action | £ | 7,82 | £ | 7,83 | £ | 9,14 |
| Distribution | £ | 17 555 | £ | 20 785 | £ | 59 979 |
| Actions émises en circulation | | 2 820 | | 3 068 | | 7 061 |
| VNI par action | £ | 6,22 | £ | 6,77 | £ | 8,50 |
| Institutions en RMB (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | CNH | 61 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | CNH | 91,17 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 6 313 | SGD | 385 | SGD | 85 |
| Actions émises en circulation | | 959 | | 53 | | 9 |
| VNI par action | SGD | 6,58 | SGD | 7,23 | SGD | 9,01 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 6 472 | \$ | 8 727 | \$ | 19 282 |
| Actions émises en circulation | | 862 | | 1 164 | | 2 201 |
| VNI par action | \$ | 7,51 | \$ | 7,50 | \$ | 8,76 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|-------------------------------------|---|--------|------------------------|--------|------------------------|---------|
| | Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite) | | | | | |
| Distribution | \$ | 48 069 | \$ | 71 688 | \$ | 273 632 |
| Actions émises en circulation | | 7 472 | | 10 304 | | 31 566 |
| VNI par action | \$ | 6,43 | \$ | 6,96 | \$ | 8,67 |
| Investisseurs en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 3 657 | AUD | 3 889 | AUD | 5 081 |
| Actions émises en circulation | | 578 | | 557 | | 579 |
| VNI par action | AUD | 6,33 | AUD | 6,99 | AUD | 8,77 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | € | 996 | € | 873 | € | 935 |
| Actions émises en circulation | | 164 | | 130 | | 110 |
| VNI par action | € | 6,05 | € | 6,69 | € | 8,52 |
| Investisseurs en RMB (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | CNH | 1 683 | CNH | 13 234 | CNH | 24 873 |
| Actions émises en circulation | | 26 | | 182 | | 275 |
| VNI par action | CNH | 65,29 | CNH | 72,74 | CNH | 90,46 |
| Investisseurs en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 2 963 | SGD | 4 112 | SGD | 6 528 |
| Actions émises en circulation | | 467 | | 591 | | 753 |
| VNI par action | SGD | 6,34 | SGD | 6,96 | SGD | 8,67 |
| Administrations : | | | | | | |
| Distribution | \$ | 22 518 | \$ | 28 245 | \$ | 41 320 |
| Actions émises en circulation | | 3 431 | | 3 980 | | 4 672 |
| VNI par action | \$ | 6,56 | \$ | 7,10 | \$ | 8,84 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 51 171 | \$ | 61 585 | \$ | 78 405 |
| Actions émises en circulation | | 6 290 | | 7 540 | | 8 175 |
| VNI par action | \$ | 8,14 | \$ | 8,17 | \$ | 9,59 |
| Distribution | \$ | 47 824 | \$ | 56 633 | \$ | 100 159 |
| Actions émises en circulation | | 7 288 | | 7 981 | | 11 325 |
| VNI par action | \$ | 6,56 | \$ | 7,10 | \$ | 8,84 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 690 | CHF | 1 012 | CHF | 1 263 |
| Actions émises en circulation | | 95 | | 133 | | 138 |
| VNI par action | CHF | 7,28 | CHF | 7,63 | CHF | 9,16 |
| Distribution | CHF | 198 | CHF | 245 | CHF | 280 |
| Actions émises en circulation | | 33 | | 36 | | 32 |
| VNI par action | CHF | 6,04 | CHF | 6,81 | CHF | 8,69 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 41 927 | € | 48 877 | € | 61 580 |
| Actions émises en circulation | | 5 605 | | 6 365 | | 6 687 |
| VNI par action | € | 7,48 | € | 7,68 | € | 9,21 |
| Distribution | € | 8 111 | € | 8 314 | € | 10 041 |
| Actions émises en circulation | | 1 312 | | 1 217 | | 1 154 |
| VNI par action | € | 6,18 | € | 6,83 | € | 8,70 |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution | HKD | 5 306 | HKD | 6 334 | HKD | 4 540 |
| Actions émises en circulation | | 812 | | 897 | | 516 |
| VNI par action | HKD | 6,54 | HKD | 7,06 | HKD | 8,79 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 12 291 | SGD | 15 239 | SGD | 25 623 |
| Actions émises en circulation | | 1 919 | | 2 168 | | 2 924 |
| VNI par action | SGD | 6,40 | SGD | 7,03 | SGD | 8,76 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 1 327 | \$ | 1 323 | \$ | 182 |
| Actions émises en circulation | | 172 | | 172 | | 20 |
| VNI par action | \$ | 7,71 | \$ | 7,69 | \$ | 8,96 |
| Distribution | \$ | 328 | \$ | 547 | \$ | 686 |
| Actions émises en circulation | | 51 | | 79 | | 80 |
| VNI par action | \$ | 6,38 | \$ | 6,90 | \$ | 8,60 |
| M Détail : | | | | | | |
| Distribution II | \$ | 18 245 | \$ | 17 613 | \$ | 22 700 |
| Actions émises en circulation | | 2 999 | | 2 637 | | 2 684 |
| VNI par action | \$ | 6,08 | \$ | 6,68 | \$ | 8,46 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|------------------------|---------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite) | | | | | | |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | HKD | 1 741 | HKD | 1 797 | HKD | 6 482 |
| Actions émises en circulation | | 288 | | 270 | | 771 |
| VNI par action | HKD | 6,05 | HKD | 6,65 | HKD | 8,41 |
| M Détail en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | SGD | 7 118 | SGD | 8 881 | SGD | 11 492 |
| Actions émises en circulation | | 1 199 | | 1 342 | | 1 372 |
| VNI par action | SGD | 5,94 | SGD | 6,62 | SGD | 8,38 |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 187 047 | \$ | 230 136 | \$ | 300 885 |
| Actions émises en circulation | | 20 248 | | 25 207 | | 28 503 |
| VNI par action | \$ | 9,24 | \$ | 9,13 | \$ | 10,56 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | | | | | |
| Actifs nets | \$ | 177 208 | \$ | 313 987 | \$ | 361 011 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 64 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 6 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,26 | | S/O | | S/O |
| Distribution | \$ | 34 211 | \$ | 54 459 | \$ | 64 997 |
| Actions émises en circulation | | 4 306 | | 6 776 | | 6 958 |
| VNI par action | \$ | 7,94 | \$ | 8,04 | \$ | 9,34 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 10 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | € | 10,13 | | S/O | | S/O |
| Distribution | € | 10 955 | € | 97 916 | € | 102 975 |
| Actions émises en circulation | | 1 445 | | 12 495 | | 11 068 |
| VNI par action | € | 7,58 | € | 7,84 | € | 9,30 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ | 351 | £ | 205 | £ | 174 |
| Actions émises en circulation | | 44 | | 26 | | 19 |
| VNI par action | £ | 7,89 | £ | 8,04 | £ | 9,41 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 15 313 | SGD | 3 799 | SGD | 5 354 |
| Actions émises en circulation | | 1 934 | | 467 | | 566 |
| VNI par action | SGD | 7,92 | SGD | 8,13 | SGD | 9,46 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 265 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 26 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,25 | | S/O | | S/O |
| Distribution | \$ | 10 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,11 | | S/O | | S/O |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 10 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | € | 10,11 | | S/O | | S/O |
| Distribution | € | 9 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | € | 10,03 | | S/O | | S/O |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 2 472 | \$ | 806 | \$ | 12 |
| Actions émises en circulation | | 277 | | 94 | | 1 |
| VNI par action | \$ | 8,93 | \$ | 8,62 | \$ | 9,69 |
| Distribution | \$ | 17 469 | \$ | 24 409 | \$ | 24 934 |
| Actions émises en circulation | | 2 511 | | 3 450 | | 3 015 |
| VNI par action | \$ | 6,96 | \$ | 7,08 | \$ | 8,27 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 5 955 | € | 5 640 | € | 5 060 |
| Actions émises en circulation | | 708 | | 680 | | 532 |
| VNI par action | € | 8,41 | € | 8,29 | € | 9,51 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|------------------------|---------|------------------------|---------|------------------------|-----------|
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite) | | | | | | |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 18 078 | € | 21 244 | € | 25 443 |
| Actions émises en circulation | | 1 275 | | 1 500 | | 1 703 |
| VNI par action | € | 14,18 | € | 14,17 | € | 14,94 |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution | HKD | 2 994 | HKD | 2 973 | HKD | 3 401 |
| Actions émises en circulation | | 377 | | 367 | | 362 |
| VNI par action | HKD | 7,95 | HKD | 8,09 | HKD | 9,40 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 3 298 | SGD | 300 | SGD | 337 |
| Actions émises en circulation | | 419 | | 37 | | 36 |
| VNI par action | SGD | 7,87 | SGD | 8,13 | SGD | 9,46 |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution | HKD | 29 265 | HKD | 31 879 | HKD | 39 857 |
| Actions émises en circulation | | 4 830 | | 5 174 | | 5 540 |
| VNI par action | HKD | 6,06 | HKD | 6,16 | HKD | 7,19 |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 65 348 | \$ | 93 351 | \$ | 109 270 |
| Actions émises en circulation | | 7 062 | | 10 610 | | 11 219 |
| VNI par action | \$ | 9,25 | \$ | 8,80 | \$ | 9,74 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | | | | | | |
| Actifs nets | \$ | 670 116 | \$ | 750 076 | \$ | 1 035 021 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 31 079 | \$ | 30 140 | \$ | 37 389 |
| Actions émises en circulation | | 1 413 | | 1 526 | | 1 571 |
| VNI par action | \$ | 22,00 | \$ | 19,74 | \$ | 23,80 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 148 956 | € | 204 979 | € | 352 099 |
| Actions émises en circulation | | 7 756 | | 11 632 | | 16 474 |
| VNI par action | € | 19,21 | € | 17,62 | € | 21,37 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ | 477 | £ | 3 301 | £ | 4 301 |
| Actions émises en circulation | | 45 | | 331 | | 345 |
| VNI par action | £ | 10,60 | £ | 9,99 | £ | 12,45 |
| Institutions en RMB (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CNH | 7 574 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 73 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | CNH | 103,47 | | S/O | | S/O |
| Distribution | CNH | 76 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | CNH | 102,34 | | S/O | | S/O |
| Institutions en RMB (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CNH | 76 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | CNH | 103,83 | | S/O | | S/O |
| Distribution | CNH | 76 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | CNH | 102,71 | | S/O | | S/O |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 11 288 | \$ | 10 303 | \$ | 10 116 |
| Actions émises en circulation | | 695 | | 704 | | 571 |
| VNI par action | \$ | 16,24 | \$ | 14,63 | \$ | 17,70 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 31 174 | \$ | 32 627 | \$ | 40 303 |
| Actions émises en circulation | | 1 686 | | 1 942 | | 1 966 |
| VNI par action | \$ | 18,49 | \$ | 16,80 | \$ | 20,50 |
| Distribution | \$ | 12 347 | \$ | 13 011 | \$ | 13 372 |
| Actions émises en circulation | | 1 302 | | 1 448 | | 1 172 |
| VNI par action | \$ | 9,48 | \$ | 8,98 | \$ | 11,41 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au | | Au | | Au | |
|--|------------------|-----------|------------------|-----------|------------------|-----------|
| | 31 décembre 2023 | | 31 décembre 2022 | | 31 décembre 2021 | |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund (suite) | | | | | | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 230 322 | € | 217 239 | € | 230 733 |
| Actions émises en circulation | | 14 269 | | 14 494 | | 12 541 |
| VNI par action | € | 16,14 | € | 14,99 | € | 18,40 |
| Distribution | € | 47 057 | € | 49 389 | € | 57 708 |
| Actions émises en circulation | | 5 608 | | 6 071 | | 5 551 |
| VNI par action | € | 8,39 | € | 8,14 | € | 10,40 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 10 | \$ | 9 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,49 | \$ | 9,43 | | S/O |
| Distribution | \$ | 10 | \$ | 9 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 9,79 | \$ | 9,18 | | S/O |
| M Détail : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 10 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,41 | | S/O | | S/O |
| Distribution | \$ | 10 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,37 | | S/O | | S/O |
| Distribution II | \$ | 10 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,35 | | S/O | | S/O |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | HKD | 81 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 8 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | HKD | 10,40 | | S/O | | S/O |
| Distribution | HKD | 81 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 8 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | HKD | 10,37 | | S/O | | S/O |
| Distribution II | HKD | 81 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 8 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | HKD | 10,34 | | S/O | | S/O |
| M Détail en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 1 420 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 137 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | SGD | 10,37 | | S/O | | S/O |
| Distribution | SGD | 14 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | SGD | 10,33 | | S/O | | S/O |
| Distribution II | SGD | 14 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | SGD | 10,31 | | S/O | | S/O |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 110 390 | \$ | 156 684 | \$ | 199 594 |
| Actions émises en circulation | | 6 669 | | 10 644 | | 11 355 |
| VNI par action | \$ | 16,55 | \$ | 14,72 | \$ | 17,58 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | | | | | |
| Actifs nets | \$ | 5 137 886 | \$ | 5 721 591 | \$ | 9 110 409 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 1 271 099 | \$ | 1 352 729 | \$ | 2 296 596 |
| Actions émises en circulation | | 59 553 | | 69 143 | | 103 846 |
| VNI par action | \$ | 21,34 | \$ | 19,56 | \$ | 22,12 |
| Distribution | \$ | 194 714 | \$ | 393 584 | \$ | 728 260 |
| Actions émises en circulation | | 19 008 | | 39 825 | | 62 402 |
| VNI par action | \$ | 10,24 | \$ | 9,88 | \$ | 11,67 |
| Institutions en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | AUD | 14 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | AUD | 9,90 |

| | Au | | Au | | Au | |
|--|------------------|-----------|------------------|-----------|------------------|-----------|
| | 31 décembre 2023 | | 31 décembre 2022 | | 31 décembre 2021 | |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite) | | | | | | |
| Institutions en BRL (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 13 282 | \$ | 25 163 | \$ | 47 342 |
| Actions émises en circulation | | 1 272 | | 3 040 | | 5 855 |
| VNI par action | \$ | 10,44 | \$ | 8,28 | \$ | 8,09 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 36 703 | CHF | 52 485 | CHF | 120 911 |
| Actions émises en circulation | | 2 326 | | 3 478 | | 6 908 |
| VNI par action | CHF | 15,78 | CHF | 15,09 | CHF | 17,50 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 1 018 876 | € | 1 198 101 | € | 1 868 333 |
| Actions émises en circulation | | 70 150 | | 88 171 | | 118 946 |
| VNI par action | € | 14,52 | € | 13,59 | € | 15,71 |
| Distribution | € | 384 027 | € | 383 951 | € | 481 884 |
| Actions émises en circulation | | 36 374 | | 36 928 | | 38 373 |
| VNI par action | € | 10,56 | € | 10,40 | € | 12,56 |
| Distribution II | € | 5 467 | € | 31 417 | € | 41 671 |
| Actions émises en circulation | | 687 | | 3 979 | | 4 334 |
| VNI par action | € | 7,96 | € | 7,89 | € | 9,61 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 47 691 | £ | 35 494 | £ | 43 301 |
| Actions émises en circulation | | 3 119 | | 2 518 | | 2 696 |
| VNI par action | £ | 15,29 | £ | 14,10 | £ | 16,06 |
| Distribution | £ | 64 345 | £ | 67 663 | £ | 106 976 |
| Actions émises en circulation | | 5 682 | | 6 132 | | 8 135 |
| VNI par action | £ | 11,32 | £ | 11,03 | £ | 13,15 |
| Institutions en RMB (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | CNH | 66 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | CNH | 100,31 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 2 530 | SGD | 178 | SGD | 39 |
| Actions émises en circulation | | 295 | | 21 | | 4 |
| VNI par action | SGD | 8,56 | SGD | 8,38 | SGD | 9,91 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 190 106 | \$ | 215 127 | \$ | 345 234 |
| Actions émises en circulation | | 13 146 | | 16 173 | | 22 879 |
| VNI par action | \$ | 14,46 | \$ | 13,30 | \$ | 15,09 |
| Distribution | \$ | 50 228 | \$ | 72 649 | \$ | 245 968 |
| Actions émises en circulation | | 4 925 | | 7 387 | | 21 180 |
| VNI par action | \$ | 10,20 | \$ | 9,84 | \$ | 11,61 |
| Investisseurs en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 14 433 | AUD | 12 971 | AUD | 26 915 |
| Actions émises en circulation | | 1 568 | | 1 437 | | 2 496 |
| VNI par action | AUD | 9,21 | AUD | 9,03 | AUD | 10,79 |
| Investisseurs en CAD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | CAD | 4 254 | CAD | 4 043 | CAD | 4 771 |
| Actions émises en circulation | | 442 | | 432 | | 431 |
| VNI par action | CAD | 9,63 | CAD | 9,35 | CAD | 11,08 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 23 439 | € | 23 367 | € | 49 337 |
| Actions émises en circulation | | 1 863 | | 1 978 | | 3 601 |
| VNI par action | € | 12,58 | € | 11,81 | € | 13,70 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|---------------------------------------|---------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 5 652 | SGD | 5 576 | SGD | 5 453 |
| Actions émises en circulation | | 602 | | 635 | | 541 |
| VNI par action | SGD | 9,39 | SGD | 8,78 | SGD | 10,08 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | \$ | 3 214 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 321 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 10,00 |
| Capitalisation | \$ | 11 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,72 | | S/O | | S/O |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | € | 8 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 9,92 |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 77 | SEK | 73 | SEK | 86 |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | 1 |
| VNI par action | SEK | 89,71 | SEK | 84,84 | SEK | 99,39 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 16 552 | € | 15 976 | € | 16 979 |
| Actions émises en circulation | | 1 877 | | 1 909 | | 1 718 |
| VNI par action | € | 8,82 | € | 8,37 | € | 9,88 |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 10 | \$ | 9 | \$ | 10 |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | 1 |
| VNI par action | \$ | 9,75 | \$ | 8,93 | \$ | 10,18 |
| Actifs nets | \$ | 858 902 | \$ | 1 369 877 | \$ | 1 444 182 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 311 581 | \$ | 397 781 | \$ | 587 333 |
| Actions émises en circulation | | 35 010 | | 41 220 | | 67 481 |
| VNI par action | \$ | 8,90 | \$ | 9,65 | \$ | 8,70 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 112 842 | € | 225 302 | € | 144 220 |
| Actions émises en circulation | | 13 338 | | 23 996 | | 16 678 |
| VNI par action | € | 8,46 | € | 9,39 | € | 8,65 |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 55 160 | € | 87 086 | € | 48 990 |
| Actions émises en circulation | | 4 639 | | 6 527 | | 4 337 |
| VNI par action | € | 11,89 | € | 13,34 | € | 11,29 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 18 532 | £ | 39 019 | £ | 36 172 |
| Actions émises en circulation | | 1 537 | | 2 963 | | 3 012 |
| VNI par action | £ | 12,06 | £ | 13,17 | £ | 12,01 |
| Institutions en GBP (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ | 18 467 | £ | 17 587 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 2 340 | | 1 881 | | S/O |
| VNI par action | £ | 7,89 | £ | 9,35 | | S/O |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 21 974 | \$ | 50 111 | \$ | 64 377 |
| Actions émises en circulation | | 2 873 | | 6 022 | | 8 546 |
| VNI par action | \$ | 7,65 | \$ | 8,32 | \$ | 7,53 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|-------------------------------------|--|-----------|------------------------|-----------|------------------------|------------|
| | Fonds Commodity Real Return Fund (suite) | | | | | |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 162 379 | \$ | 260 353 | \$ | 256 747 |
| Actions émises en circulation | | 23 016 | | 33 734 | | 36 552 |
| VNI par action | \$ | 7,06 | \$ | 7,72 | \$ | 7,02 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 111 508 | € | 238 920 | € | 234 570 |
| Actions émises en circulation | | 17 383 | | 33 254 | | 35 127 |
| VNI par action | € | 6,41 | € | 7,18 | € | 6,68 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 1 207 | SGD | 2 069 | SGD | 352 |
| Actions émises en circulation | | 119 | | 183 | | 34 |
| VNI par action | SGD | 10,18 | SGD | 11,30 | SGD | 10,32 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 6 125 | \$ | 3 614 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 786 | | 427 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 7,79 | \$ | 8,46 | | S/O |
| Actifs nets | \$ | 100 063 | \$ | 97 153 | \$ | 139 704 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 48 421 | \$ | 44 986 | \$ | 47 099 |
| Actions émises en circulation | | 3 281 | | 3 318 | | 3 345 |
| VNI par action | \$ | 14,76 | \$ | 13,56 | \$ | 14,07 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 11 825 | CHF | 15 367 | CHF | 22 488 |
| Actions émises en circulation | | 1 105 | | 1 500 | | 2 060 |
| VNI par action | CHF | 10,71 | CHF | 10,24 | CHF | 10,92 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 15 758 | € | 15 443 | € | 39 139 |
| Actions émises en circulation | | 1 256 | | 1 312 | | 3 136 |
| VNI par action | € | 12,54 | € | 11,77 | € | 12,48 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 8 932 | \$ | 8 985 | \$ | 9 740 |
| Actions émises en circulation | | 740 | | 803 | | 831 |
| VNI par action | \$ | 12,08 | \$ | 11,20 | \$ | 11,73 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 10 187 | € | 9 455 | € | 12 026 |
| Actions émises en circulation | | 990 | | 971 | | 1 154 |
| VNI par action | € | 10,29 | € | 9,74 | € | 10,42 |
| Actifs nets | \$ | 7 439 798 | \$ | 8 751 796 | \$ | 16 447 733 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 624 037 | \$ | 824 847 | \$ | 1 243 637 |
| Actions émises en circulation | | 24 230 | | 35 047 | | 44 236 |
| VNI par action | \$ | 25,76 | \$ | 23,54 | \$ | 28,11 |
| Distribution | \$ | 297 569 | \$ | 352 231 | \$ | 692 397 |
| Actions émises en circulation | | 22 611 | | 27 897 | | 44 132 |
| VNI par action | \$ | 13,16 | \$ | 12,63 | \$ | 15,69 |
| Institutions en CAD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CAD | 465 402 | CAD | 441 412 | CAD | 571 190 |
| Actions émises en circulation | | 43 934 | | 45 218 | | 48 824 |
| VNI par action | CAD | 10,59 | CAD | 9,76 | CAD | 11,70 |

| | | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|-----|---------------------------------------|-------|------------------------|-------|------------------------|--|
| | | Fonds Diversified Income Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 13 431 | CHF | 15 646 | CHF | 20 277 | |
| Actions émises en circulation | | 1 065 | | 1 299 | | 1 371 | |
| VNI par action | CHF | 12,61 | CHF | 12,04 | CHF | 14,79 | |
| Distribution | CHF | 5 215 | CHF | 8 022 | CHF | 13 028 | |
| Actions émises en circulation | | 724 | | 1 111 | | 1 412 | |
| VNI par action | CHF | 7,20 | CHF | 7,22 | CHF | 9,23 | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 889 868 | € | 998 452 | € | 1 703 682 | |
| Actions émises en circulation | | 54 327 | | 65 216 | | 90 940 | |
| VNI par action | € | 16,38 | € | 15,31 | € | 18,73 | |
| Distribution | € | 201 004 | € | 330 342 | € | 852 032 | |
| Actions émises en circulation | | 25 470 | | 42 647 | | 86 306 | |
| VNI par action | € | 7,89 | € | 7,75 | € | 9,87 | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 519 724 | £ | 572 158 | £ | 1 248 141 | |
| Actions émises en circulation | | 37 644 | | 44 993 | | 81 268 | |
| VNI par action | £ | 13,81 | £ | 12,72 | £ | 15,36 | |
| Distribution | £ | 267 079 | £ | 391 080 | £ | 601 893 | |
| Actions émises en circulation | | 44 733 | | 67 375 | | 81 620 | |
| VNI par action | £ | 5,97 | £ | 5,80 | £ | 7,37 | |
| Institutions en MXN (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | MXN | 407 573 | MXN | 270 310 | MXN | 299 232 | |
| Actions émises en circulation | | 3 696 | | 2 863 | | 2 831 | |
| VNI par action | MXN | 110,27 | MXN | 94,40 | MXN | 105,70 | |
| Institutions en SEK (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 180 061 | SEK | 168 340 | SEK | 205 009 | |
| Actions émises en circulation | | 1 058 | | 1 058 | | 1 057 | |
| VNI par action | SEK | 170,25 | SEK | 159,10 | SEK | 193,88 | |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | | |
| Distribution | SGD | 8 210 | SGD | 43 716 | SGD | 79 938 | |
| Actions émises en circulation | | 982 | | 5 366 | | 7 873 | |
| VNI par action | SGD | 8,36 | SGD | 8,15 | SGD | 10,15 | |
| Investisseurs : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 37 372 | \$ | 53 597 | \$ | 83 045 | |
| Actions émises en circulation | | 2 872 | | 4 492 | | 5 806 | |
| VNI par action | \$ | 13,01 | \$ | 11,93 | \$ | 14,30 | |
| Distribution | \$ | 97 875 | \$ | 89 559 | \$ | 69 026 | |
| Actions émises en circulation | | 11 003 | | 10 495 | | 6 522 | |
| VNI par action | \$ | 8,89 | \$ | 8,53 | \$ | 10,58 | |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 18 112 | € | 21 418 | € | 34 903 | |
| Actions émises en circulation | | 1 171 | | 1 477 | | 1 960 | |
| VNI par action | € | 15,46 | € | 14,50 | € | 17,81 | |
| Distribution | € | 9 072 | € | 10 066 | € | 11 743 | |
| Actions émises en circulation | | 1 216 | | 1 375 | | 1 260 | |
| VNI par action | € | 7,46 | € | 7,32 | € | 9,32 | |
| Administrations : | | | | | | | |
| Distribution | \$ | 70 001 | \$ | 87 885 | \$ | 143 334 | |
| Actions émises en circulation | | 7 208 | | 9 431 | | 12 385 | |
| VNI par action | \$ | 9,71 | \$ | 9,32 | \$ | 11,57 | |
| Administrations en AUD (couverte) : | | | | | | | |
| Distribution | S/O | AUD | 2 794 | AUD | 3 812 | | |
| Actions émises en circulation | | S/O | 341 | | 370 | | |
| VNI par action | S/O | AUD | 8,18 | AUD | 10,30 | | |
| Administrations en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 3 265 | € | 4 330 | € | 10 014 | |
| Actions émises en circulation | | 217 | | 306 | | 575 | |
| VNI par action | € | 15,08 | € | 14,16 | € | 17,42 | |

| | | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|-----|---------------------------------------|-----|------------------------|-----|------------------------|--|
| | | Fonds Diversified Income Fund (suite) | | | | | |
| Administrations en GBP (couverte) : | | | | | | | |
| Distribution | £ | 7 739 | £ | 8 358 | £ | 12 610 | |
| Actions émises en circulation | | 870 | | 972 | | 1 168 | |
| VNI par action | £ | 8,89 | £ | 8,60 | £ | 10,80 | |
| Administrations en JPY (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | ¥ | 367 541 | ¥ | 354 957 | ¥ | 47 222 | |
| Actions émises en circulation | | 441 | | 438 | | 47 | |
| VNI par action | ¥ | 833,00 | ¥ | 811,00 | ¥ | 1 002,00 | |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 73 | SEK | 78 | SEK | 84 | |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | 1 | |
| VNI par action | SEK | 86,00 | SEK | 80,78 | SEK | 98,94 | |
| Administrations en SGD (couverte) : | | | | | | | |
| Distribution | SGD | 63 405 | SGD | 55 693 | SGD | 101 850 | |
| Actions émises en circulation | | 7 369 | | 6 640 | | 9 757 | |
| VNI par action | SGD | 8,60 | SGD | 8,39 | SGD | 10,44 | |
| BM Détail : | | | | | | | |
| Décumulation | \$ | 10 | S/O | | S/O | | |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O | |
| VNI par action | \$ | 9,95 | | S/O | | S/O | |
| Distribution II | \$ | 33 787 | \$ | 9 | | S/O | |
| Actions émises en circulation | | 3 628 | | 1 | | S/O | |
| VNI par action | \$ | 9,31 | \$ | 9,17 | | S/O | |
| BN Détail : | | | | | | | |
| Distribution II | | S/O | \$ | 9 | | S/O | |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 1 | | S/O | |
| VNI par action | | S/O | \$ | 9,17 | | S/O | |
| Catégorie E : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 577 044 | \$ | 655 637 | \$ | 1 113 069 | |
| Actions émises en circulation | | 26 246 | | 32 342 | | 45 554 | |
| VNI par action | \$ | 21,99 | \$ | 20,27 | \$ | 24,43 | |
| Distribution | \$ | 300 411 | \$ | 372 507 | \$ | 630 798 | |
| Actions émises en circulation | | 25 563 | | 33 038 | | 45 041 | |
| VNI par action | \$ | 11,75 | \$ | 11,28 | \$ | 14,01 | |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 5 734 | CHF | 7 655 | CHF | 9 701 | |
| Actions émises en circulation | | 663 | | 918 | | 939 | |
| VNI par action | CHF | 8,65 | CHF | 8,34 | CHF | 10,33 | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 949 425 | € | 1 292 425 | € | 1 880 735 | |
| Actions émises en circulation | | 66 761 | | 96 369 | | 113 579 | |
| VNI par action | € | 14,22 | € | 13,41 | € | 16,56 | |
| Distribution | € | 618 912 | € | 781 155 | € | 1 366 978 | |
| Actions émises en circulation | | 68 720 | | 88 377 | | 121 500 | |
| VNI par action | € | 9,01 | € | 8,84 | € | 11,25 | |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | | |
| Distribution | SGD | 17 307 | SGD | 22 377 | SGD | 47 272 | |
| Actions émises en circulation | | 2 078 | | 2 757 | | 4 674 | |
| VNI par action | SGD | 8,33 | SGD | 8,12 | SGD | 10,11 | |
| H Institutions : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 456 350 | \$ | 385 630 | \$ | 1 501 526 | |
| Actions émises en circulation | | 23 526 | | 21 717 | | 70 674 | |
| VNI par action | \$ | 19,40 | \$ | 17,76 | \$ | 21,25 | |
| Distribution | \$ | 197 | \$ | 118 | \$ | 26 | |
| Actions émises en circulation | | 22 | | 14 | | 2 | |
| VNI par action | \$ | 8,98 | \$ | 8,61 | \$ | 10,70 | |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Diversified Income Fund (suite) | | | |
| M Détail : | | | |
| Décumulation | \$ 10 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | \$ 9,95 | S/O | S/O |
| Distribution | \$ 129 257 | \$ 150 260 | \$ 246 412 |
| Actions émises en circulation | 12 858 | 15 573 | 20 577 |
| VNI par action | \$ 10,05 | \$ 9,65 | \$ 11,98 |
| Distribution II | \$ 164 458 | \$ 183 635 | \$ 311 977 |
| Actions émises en circulation | 20 705 | 23 717 | 31 930 |
| VNI par action | \$ 7,94 | \$ 7,74 | \$ 9,77 |
| M Détail en AUD (couverte) : | | | |
| Distribution | AUD 43 631 | AUD 49 591 | AUD 83 307 |
| Actions émises en circulation | 4 793 | 5 574 | 7 442 |
| VNI par action | AUD 9,10 | AUD 8,90 | AUD 11,19 |
| M Détail en SGD (couverte) : | | | |
| Distribution II | S/O | S/O | SGD 13 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 1 |
| VNI par action | S/O | S/O | SGD 9,82 |
| N Détail : | | | |
| Distribution II | \$ 9 | \$ 9 | \$ 10 |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | 1 |
| VNI par action | \$ 9,34 | \$ 8,61 | \$ 10,38 |
| Catégorie T : | | | |
| Capitalisation | \$ 24 098 | \$ 25 356 | \$ 40 854 |
| Actions émises en circulation | 2 039 | 2 318 | 3 086 |
| VNI par action | \$ 11,82 | \$ 10,94 | \$ 13,24 |
| Distribution | \$ 6 268 | \$ 6 829 | \$ 9 630 |
| Actions émises en circulation | 679 | 771 | 876 |
| VNI par action | \$ 9,23 | \$ 8,85 | \$ 11,00 |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 36 498 | € 36 445 | € 53 705 |
| Actions émises en circulation | 3 682 | 3 883 | 4 616 |
| VNI par action | € 9,91 | € 9,38 | € 11,63 |
| Distribution | € 18 999 | € 19 507 | € 28 295 |
| Actions émises en circulation | 2 463 | 2 576 | 2 937 |
| VNI par action | € 7,71 | € 7,57 | € 9,63 |
| Catégorie W : | | | |
| Capitalisation | \$ 29 812 | \$ 64 400 | \$ 120 525 |
| Actions émises en circulation | 3 117 | 7 380 | 11 579 |
| VNI par action | \$ 9,56 | \$ 8,73 | \$ 10,41 |
| Distribution | \$ 11 290 | \$ 45 458 | \$ 137 527 |
| Actions émises en circulation | 1 352 | 5 672 | 13 806 |
| VNI par action | \$ 8,35 | \$ 8,01 | \$ 9,96 |
| Catégorie W en CAD (couverte) : | | | |
| Capitalisation | S/O | S/O | CAD 14 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 1 |
| VNI par action | S/O | S/O | CAD 10,38 |
| Catégorie W en CHF (couverte) : | | | |
| Capitalisation | CHF 1 522 | CHF 10 994 | CHF 13 719 |
| Actions émises en circulation | 174 | 1 317 | 1 339 |
| VNI par action | CHF 8,76 | CHF 8,35 | CHF 10,24 |
| Distribution | CHF 428 | CHF 699 | CHF 1 588 |
| Actions émises en circulation | 56 | 91 | 162 |
| VNI par action | CHF 7,65 | CHF 7,67 | CHF 9,80 |
| Catégorie W en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 4 968 | € 11 937 | € 15 286 |
| Actions émises en circulation | 552 | 1 420 | 1 488 |
| VNI par action | € 9,01 | € 8,40 | € 10,27 |
| Distribution | € 1 078 | € 3 382 | € 6 737 |
| Actions émises en circulation | 137 | 438 | 685 |
| VNI par action | € 7,87 | € 7,72 | € 9,83 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Diversified Income Fund (suite) | | | |
| Catégorie W en GBP (couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 281 | £ 2 089 | £ 2 371 |
| Actions émises en circulation | 30 | 243 | 229 |
| VNI par action | £ 9,34 | £ 8,59 | £ 10,36 |
| Distribution | £ 334 | £ 2 895 | £ 3 547 |
| Actions émises en circulation | 41 | 367 | 358 |
| VNI par action | £ 8,16 | £ 7,89 | £ 9,92 |
| Catégorie W en SGD (couverte) : | | | |
| Distribution | SGD 1 574 | SGD 3 079 | SGD 4 762 |
| Actions émises en circulation | 192 | 385 | 477 |
| VNI par action | SGD 8,21 | SGD 8,00 | SGD 9,97 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 412 839 | \$ 564 684 | \$ 1 305 365 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 18 800 | \$ 23 243 | \$ 64 311 |
| Actions émises en circulation | 1 197 | 1 617 | 4 288 |
| VNI par action | \$ 15,70 | \$ 14,38 | \$ 15,00 |
| Distribution | S/O | S/O | \$ 3 462 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 326 |
| VNI par action | S/O | S/O | \$ 10,63 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 13 663 | € 87 225 | € 165 664 |
| Actions émises en circulation | 1 004 | 6 863 | 12 228 |
| VNI par action | € 13,61 | € 12,71 | € 13,55 |
| Distribution II | € 9 164 | € 9 995 | € 40 816 |
| Actions émises en circulation | 1 266 | 1 372 | 5 012 |
| VNI par action | € 7,24 | € 7,29 | € 8,14 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 153 980 | £ 182 935 | £ 312 905 |
| Actions émises en circulation | 10 174 | 13 134 | 21 396 |
| VNI par action | £ 15,14 | £ 13,93 | £ 14,62 |
| Distribution | £ 41 868 | £ 63 760 | £ 176 678 |
| Actions émises en circulation | 5 208 | 7 894 | 19 855 |
| VNI par action | £ 8,04 | £ 8,08 | £ 8,90 |
| Investisseurs : | | | |
| Capitalisation | \$ 5 078 | \$ 5 125 | \$ 11 010 |
| Actions émises en circulation | 389 | 428 | 878 |
| VNI par action | \$ 13,04 | \$ 11,98 | \$ 12,54 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 18 689 | \$ 24 033 | \$ 46 891 |
| Actions émises en circulation | 1 475 | 2 054 | 3 805 |
| VNI par action | \$ 12,67 | \$ 11,70 | \$ 12,32 |
| Distribution | \$ 30 961 | \$ 33 306 | \$ 38 488 |
| Actions émises en circulation | 3 261 | 3 579 | 3 808 |
| VNI par action | \$ 9,49 | \$ 9,30 | \$ 10,11 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 40 505 | € 54 593 | € 184 920 |
| Actions émises en circulation | 3 284 | 4 696 | 14 788 |
| VNI par action | € 12,34 | € 11,63 | € 12,50 |
| Distribution | € 17 818 | € 18 931 | € 29 006 |
| Actions émises en circulation | 2 363 | 2 511 | 3 466 |
| VNI par action | € 7,54 | € 7,54 | € 8,37 |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 57 563 | \$ 9 854 | |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 10 289 | \$ 9 367 | S/O |
| Actions émises en circulation | 947 | 947 | S/O |
| VNI par action | \$ 10,87 | \$ 9,89 | S/O |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|-------------------------------------|---|-------------------------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Diversified Income ESG Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 42 539 | € | 226 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 4 056 | | 23 | | S/O |
| VNI par action | € | 10,49 | € | 9,76 | | S/O |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 205 | £ | 188 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 19 | | 19 | | S/O |
| VNI par action | £ | 10,71 | £ | 9,83 | | S/O |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 11 | \$ | 10 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,73 | \$ | 9,85 | | S/O |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 10 | € | 9 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | € | 10,36 | € | 9,73 | | S/O |
| | | Fonds Dynamic Bond Fund | | | | |
| Actifs nets | \$ | 3 445 573 | \$ | 3 483 601 | \$ | 3 277 997 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 339 706 | \$ | 470 460 | \$ | 626 628 |
| Actions émises en circulation | | 23 366 | | 34 671 | | 42 473 |
| VNI par action | \$ | 14,54 | \$ | 13,57 | \$ | 14,75 |
| Distribution | \$ | 84 564 | \$ | 81 771 | \$ | 100 397 |
| Actions émises en circulation | | 8 063 | | 8 057 | | 8 882 |
| VNI par action | \$ | 10,49 | \$ | 10,15 | \$ | 11,30 |
| Institutions en CAD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CAD | 10 727 | CAD | 11 952 | CAD | 15 351 |
| Actions émises en circulation | | 999 | | 1 186 | | 1 398 |
| VNI par action | CAD | 10,73 | CAD | 10,08 | CAD | 10,98 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 2 845 | CHF | 70 173 | CHF | 87 168 |
| Actions émises en circulation | | 279 | | 7 073 | | 7 873 |
| VNI par action | CHF | 10,20 | CHF | 9,92 | CHF | 11,07 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 92 451 | € | 187 622 | € | 348 406 |
| Actions émises en circulation | | 7 438 | | 15 837 | | 26 481 |
| VNI par action | € | 12,43 | € | 11,85 | € | 13,16 |
| Distribution | € | 5 783 | € | 11 318 | € | 12 768 |
| Actions émises en circulation | | 648 | | 1 283 | | 1 272 |
| VNI par action | € | 8,93 | € | 8,82 | € | 10,04 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 1 929 593 | £ | 1 840 373 | £ | 887 562 |
| Actions émises en circulation | | 150 264 | | 152 611 | | 67 216 |
| VNI par action | £ | 12,84 | £ | 12,06 | £ | 13,20 |
| Distribution | £ | 95 339 | £ | 94 155 | £ | 253 262 |
| Actions émises en circulation | | 10 814 | | 10 906 | | 26 086 |
| VNI par action | £ | 8,82 | £ | 8,63 | £ | 9,71 |
| Institutions en NOK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | NOK | 3 465 | NOK | 4 066 | NOK | 131 604 |
| Actions émises en circulation | | 273 | | 337 | | 9 965 |
| VNI par action | NOK | 12,72 | NOK | 12,07 | NOK | 13,21 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|---------------------------------|--------|------------------------|--------|------------------------|---------|
| | Fonds Dynamic Bond Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | SEK | 24 943 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 237 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | SEK | 105,17 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 44 681 | \$ | 46 677 | \$ | 56 790 |
| Actions émises en circulation | | 3 648 | | 4 069 | | 4 537 |
| VNI par action | \$ | 12,25 | \$ | 11,47 | \$ | 12,52 |
| Distribution | \$ | 1 272 | \$ | 2 830 | \$ | 3 932 |
| Actions émises en circulation | | 136 | | 312 | | 389 |
| VNI par action | \$ | 9,38 | \$ | 9,08 | \$ | 10,11 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 2 053 | € | 2 013 | € | 5 744 |
| Actions émises en circulation | | 195 | | 200 | | 512 |
| VNI par action | € | 10,54 | € | 10,08 | € | 11,23 |
| Administrations : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 15 191 | \$ | 21 094 | \$ | 29 563 |
| Actions émises en circulation | | 1 121 | | 1 659 | | 2 128 |
| VNI par action | \$ | 13,56 | \$ | 12,72 | \$ | 13,90 |
| Administrations en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 959 | € | 1 170 | € | 3 659 |
| Actions émises en circulation | | 83 | | 105 | | 295 |
| VNI par action | € | 11,60 | € | 11,11 | € | 12,40 |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 55 239 | SEK | 61 257 | SEK | 81 744 |
| Actions émises en circulation | | 515 | | 597 | | 718 |
| VNI par action | SEK | 107,23 | SEK | 102,58 | SEK | 113,88 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 67 914 | \$ | 69 989 | \$ | 92 812 |
| Actions émises en circulation | | 5 807 | | 6 354 | | 7 680 |
| VNI par action | \$ | 11,70 | \$ | 11,01 | \$ | 12,08 |
| Distribution | \$ | 13 906 | \$ | 14 979 | \$ | 19 242 |
| Actions émises en circulation | | 1 451 | | 1 615 | | 1 862 |
| VNI par action | \$ | 9,59 | \$ | 9,28 | \$ | 10,33 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 7 671 | CHF | 8 868 | CHF | 10 761 |
| Actions émises en circulation | | 850 | | 1 000 | | 1 078 |
| VNI par action | CHF | 9,03 | CHF | 8,86 | CHF | 9,98 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 66 769 | € | 73 068 | € | 138 697 |
| Actions émises en circulation | | 6 094 | | 6 936 | | 11 750 |
| VNI par action | € | 10,96 | € | 10,54 | € | 11,80 |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 1 882 | £ | 3 354 | £ | 3 820 |
| Actions émises en circulation | | 169 | | 318 | | 328 |
| VNI par action | £ | 11,13 | £ | 10,55 | £ | 11,65 |
| G Détail en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | € | 5 890 | € | 7 061 | € | 8 905 |
| Actions émises en circulation | | 736 | | 896 | | 992 |
| VNI par action | € | 8,00 | € | 7,88 | € | 8,98 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 44 168 | \$ | 11 541 | \$ | 18 571 |
| Actions émises en circulation | | 4 058 | | 1 135 | | 1 677 |
| VNI par action | \$ | 10,88 | \$ | 10,17 | \$ | 11,08 |
| Distribution | | S/O | | 10 | | 11 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 1 | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | 9,12 | | 10,16 |
| Catégorie R : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 4 839 | \$ | 6 385 | \$ | 7 736 |
| Actions émises en circulation | | 408 | | 577 | | 642 |
| VNI par action | \$ | 11,85 | \$ | 11,07 | \$ | 12,05 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|-----------------------------------|---------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Dynamic Bond Fund (suite) | | | | | |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 15 699 | \$ | 6 683 | \$ | 9 940 |
| Actions émises en circulation | | 1 576 | | 725 | | 1 001 |
| VNI par action | \$ | 9,96 | \$ | 9,22 | \$ | 9,93 |
| Catégorie Z en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 16 551 | AUD | 27 023 | AUD | 36 313 |
| Actions émises en circulation | | 1 767 | | 2 938 | | 3 513 |
| VNI par action | AUD | 9,36 | AUD | 9,20 | AUD | 10,34 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | | | | | | |
| Actifs nets | € | 3 262 045 | € | 5 115 170 | € | 7 635 950 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 1 030 988 | € | 1 644 656 | € | 2 765 020 |
| Actions émises en circulation | | 86 743 | | 137 719 | | 198 997 |
| VNI par action | € | 11,89 | € | 11,94 | € | 13,89 |
| Distribution II | € | 120 582 | € | 158 729 | € | 238 007 |
| Actions émises en circulation | | 11 229 | | 14 419 | | 18 212 |
| VNI par action | € | 10,74 | € | 11,01 | € | 13,07 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 2 459 | CHF | 3 063 | CHF | 5 282 |
| Actions émises en circulation | | 245 | | 297 | | 438 |
| VNI par action | CHF | 10,04 | CHF | 10,31 | CHF | 12,06 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 407 097 | £ | 552 226 | £ | 576 557 |
| Actions émises en circulation | | 31 957 | | 43 745 | | 39 733 |
| VNI par action | £ | 12,74 | £ | 12,62 | £ | 14,51 |
| Distribution | £ | 10 386 | £ | 33 675 | £ | 17 109 |
| Actions émises en circulation | | 955 | | 3 025 | | 1 337 |
| VNI par action | £ | 10,88 | £ | 11,13 | £ | 12,79 |
| Institutions en ILS (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | ILS | 16 594 | ILS | 4 206 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 668 | | 423 | | S/O |
| VNI par action | ILS | 9,95 | ILS | 9,93 | | S/O |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 81 668 | SGD | 109 428 | SGD | 27 017 |
| Actions émises en circulation | | 9 303 | | 12 486 | | 2 702 |
| VNI par action | SGD | 8,78 | SGD | 8,76 | SGD | 10,00 |
| Institutions en USD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 113 739 | \$ | 156 343 | \$ | 281 670 |
| Actions émises en circulation | | 8 164 | | 11 438 | | 18 087 |
| VNI par action | \$ | 13,93 | \$ | 13,67 | \$ | 15,57 |
| Distribution II | \$ | 4 415 | \$ | 4 450 | \$ | 5 074 |
| Actions émises en circulation | | 531 | | 531 | | 512 |
| VNI par action | \$ | 8,31 | \$ | 8,38 | \$ | 9,92 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 9 375 | € | 10 626 | € | 11 030 |
| Actions émises en circulation | | 1 014 | | 1 140 | | 1 013 |
| VNI par action | € | 9,25 | € | 9,32 | € | 10,89 |
| Investisseurs en USD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | S/O | \$ | 9 | \$ | 10 | |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 1 | | 1 |
| VNI par action | S/O | \$ | 8,94 | \$ | 10,22 | |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|------------------------------------|--|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite) | | | | | |
| BM Détail en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | AUD | 161 | AUD | 12 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 18 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | AUD | 8,75 | AUD | 9,19 | | S/O |
| BM Détail en USD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | \$ | 604 | \$ | 9 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 67 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 8,97 | \$ | 9,25 | | S/O |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 1 109 492 | € | 1 913 579 | € | 2 955 626 |
| Actions émises en circulation | | 101 172 | | 171 934 | | 225 981 |
| VNI par action | € | 10,97 | € | 11,13 | € | 13,08 |
| Distribution | € | 3 256 | € | 4 679 | € | 5 627 |
| Actions émises en circulation | | 361 | | 506 | | 517 |
| VNI par action | € | 9,02 | € | 9,25 | € | 10,87 |
| Catégorie E en USD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 125 652 | \$ | 192 230 | \$ | 275 658 |
| Actions émises en circulation | | 10 789 | | 16 657 | | 20 756 |
| VNI par action | \$ | 11,65 | \$ | 11,54 | \$ | 13,28 |
| Distribution | | S/O | \$ | 32 | \$ | 10 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 4 | | 1 |
| VNI par action | | S/O | \$ | 8,84 | \$ | 10,18 |
| Distribution II | | S/O | \$ | 9 | \$ | 10 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 1 | | 1 |
| VNI par action | | S/O | \$ | 8,27 | \$ | 9,80 |
| H Institutions en USD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 656 | \$ | 2 298 | \$ | 8 850 |
| Actions émises en circulation | | 67 | | 240 | | 810 |
| VNI par action | \$ | 9,74 | \$ | 9,58 | \$ | 10,93 |
| M Détail en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | AUD | 325 | AUD | 321 | AUD | 563 |
| Actions émises en circulation | | 41 | | 39 | | 57 |
| VNI par action | AUD | 7,85 | AUD | 8,17 | AUD | 9,87 |
| M Détail en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | SGD | 9 292 | SGD | 12 812 | SGD | 16 539 |
| Actions émises en circulation | | 1 158 | | 1 538 | | 1 673 |
| VNI par action | SGD | 8,02 | SGD | 8,33 | SGD | 9,89 |
| M Détail en USD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | \$ | 45 217 | \$ | 65 622 | \$ | 120 842 |
| Actions émises en circulation | | 5 059 | | 7 183 | | 11 077 |
| VNI par action | \$ | 8,94 | \$ | 9,14 | \$ | 10,91 |
| Catégorie T : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 67 018 | € | 83 511 | € | 118 172 |
| Actions émises en circulation | | 6 648 | | 8 130 | | 9 750 |
| VNI par action | € | 10,08 | € | 10,27 | € | 12,12 |
| Catégorie T en USD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 3 019 | \$ | 3 396 | \$ | 618 |
| Actions émises en circulation | | 353 | | 399 | | 63 |
| VNI par action | \$ | 8,56 | \$ | 8,51 | \$ | 9,83 |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 104 488 | € | 151 534 | € | 192 397 |
| Actions émises en circulation | | 9 677 | | 14 087 | | 15 504 |
| VNI par action | € | 10,80 | € | 10,76 | € | 12,41 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|---|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Emerging Local Bond Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 2 880 941 | \$ 1 919 668 | \$ 2 151 129 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 1 787 853 | \$ 1 295 760 | \$ 1 416 960 |
| Actions émises en circulation | 122 115 | 102 499 | 104 910 |
| VNI par action | \$ 14,64 | \$ 12,64 | \$ 13,51 |
| Distribution | \$ 86 891 | \$ 67 645 | \$ 77 715 |
| Actions émises en circulation | 12 960 | 11 061 | 11 365 |
| VNI par action | \$ 6,70 | \$ 6,12 | \$ 6,84 |
| Institutions en CHF (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | S/O | S/O | CHF 397 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 44 |
| VNI par action | S/O | S/O | CHF 9,06 |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 409 418 | € 172 199 | € 250 076 |
| Actions émises en circulation | 28 009 | 13 181 | 19 088 |
| VNI par action | € 14,62 | € 13,06 | € 13,10 |
| Distribution | € 160 464 | € 133 001 | € 123 817 |
| Actions émises en circulation | 22 947 | 20 143 | 17 869 |
| VNI par action | € 6,99 | € 6,60 | € 6,93 |
| Institutions en GBP (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 6 345 | £ 3 791 | £ 2 364 |
| Actions émises en circulation | 280 | 183 | 120 |
| VNI par action | £ 22,69 | £ 20,76 | £ 19,70 |
| Investisseurs : | | | |
| Capitalisation | \$ 8 219 | \$ 19 075 | \$ 38 617 |
| Actions émises en circulation | 747 | 2 001 | 3 779 |
| VNI par action | \$ 11,00 | \$ 9,53 | \$ 10,22 |
| Investisseurs en EUR (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 664 | € 698 | € 3 081 |
| Actions émises en circulation | 64 | 75 | 330 |
| VNI par action | € 10,34 | € 9,28 | € 9,33 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 41 451 | \$ 35 736 | \$ 39 398 |
| Actions émises en circulation | 3 286 | 3 249 | 3 319 |
| VNI par action | \$ 12,61 | \$ 11,00 | \$ 11,87 |
| Distribution | \$ 15 039 | \$ 12 985 | \$ 15 964 |
| Actions émises en circulation | 2 395 | 2 266 | 2 492 |
| VNI par action | \$ 6,28 | \$ 5,73 | \$ 6,41 |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 76 314 | € 65 014 | € 77 057 |
| Actions émises en circulation | 4 853 | 4 579 | 5 359 |
| VNI par action | € 15,73 | € 14,20 | € 14,38 |
| Distribution | € 1 590 | € 1 510 | € 1 782 |
| Actions émises en circulation | 167 | 168 | 189 |
| VNI par action | € 9,50 | € 8,97 | € 9,41 |
| H Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 189 970 | \$ 48 210 | \$ 10 |
| Actions émises en circulation | 18 463 | 5 416 | 1 |
| VNI par action | \$ 10,29 | \$ 8,90 | \$ 9,52 |
| Catégorie Z : | | | |
| Distribution | \$ 27 121 | \$ 38 228 | \$ 40 482 |
| Actions émises en circulation | 3 377 | 5 218 | 4 941 |
| VNI par action | \$ 8,03 | \$ 7,33 | \$ 8,19 |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 102 408 | \$ 6 609 | |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 5 975 | \$ 5 169 | S/O |
| Actions émises en circulation | 489 | 489 | S/O |
| VNI par action | \$ 12,22 | \$ 10,57 | S/O |
| Distribution | \$ 12 | \$ 11 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 11,26 | \$ 10,34 | S/O |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|---|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite) | | | |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 85 778 | € 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 7 664 | 1 | S/O |
| VNI par action | € 11,19 | € 10,02 | S/O |
| Distribution | € 10 | € 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | € 10,31 | € 9,81 | S/O |
| Institutions en GBP (non couverte) : | | | |
| Distribution | £ 8 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | £ 10,13 | S/O | S/O |
| Investisseurs : | | | |
| Capitalisation | \$ 12 | \$ 11 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 12,16 | \$ 10,56 | S/O |
| Distribution | \$ 12 | \$ 11 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 11,26 | \$ 10,34 | S/O |
| Investisseurs en EUR (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 10 | € 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | € 11,14 | € 10,01 | S/O |
| Distribution | € 10 | € 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | € 10,31 | € 9,81 | S/O |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 12 | \$ 11 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 12,05 | \$ 10,53 | S/O |
| Distribution | \$ 12 | \$ 11 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 11,25 | \$ 10,34 | S/O |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 10 | € 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | € 11,03 | € 9,98 | S/O |
| Distribution | € 10 | € 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | € 10,31 | € 9,80 | S/O |
| Catégorie Z : | | | |
| Capitalisation | \$ 1 550 | \$ 1 329 | S/O |
| Actions émises en circulation | 123 | 123 | S/O |
| VNI par action | \$ 12,57 | \$ 10,77 | S/O |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 3 846 285 | \$ 3 305 979 | \$ 4 714 744 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 1 269 939 | \$ 1 097 175 | \$ 1 578 727 |
| Actions émises en circulation | 25 159 | 24 303 | 28 997 |
| VNI par action | \$ 50,48 | \$ 45,15 | \$ 54,45 |
| Distribution | \$ 91 725 | \$ 56 849 | \$ 92 620 |
| Actions émises en circulation | 5 909 | 3 860 | 4 961 |
| VNI par action | \$ 15,52 | \$ 14,73 | \$ 18,67 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | |
| Distribution | CHF 77 520 | CHF 77 505 | CHF 97 681 |
| Actions émises en circulation | 5 347 | 5 390 | 5 215 |
| VNI par action | CHF 14,50 | CHF 14,38 | CHF 18,73 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 705 340 | € 694 951 | € 695 028 |
| Actions émises en circulation | 18 243 | 19 643 | 15 897 |
| VNI par action | € 38,66 | € 35,38 | € 43,72 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|---|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite) | | | |
| Distribution | € 438 978 | € 401 157 | € 847 991 |
| Actions émises en circulation | 62 494 | 58 854 | 95 747 |
| VNI par action | € 7,02 | € 6,82 | € 8,86 |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 179 735 | € 135 251 | € 164 246 |
| Actions émises en circulation | 14 796 | 12 028 | 12 905 |
| VNI par action | € 12,15 | € 11,24 | € 12,73 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 20 841 | £ 23 424 | £ 26 418 |
| Actions émises en circulation | 800 | 997 | 922 |
| VNI par action | £ 26,06 | £ 23,50 | £ 28,67 |
| Distribution | £ 26 761 | £ 28 487 | £ 41 458 |
| Actions émises en circulation | 7 338 | 8 167 | 9 258 |
| VNI par action | £ 3,65 | £ 3,49 | £ 4,48 |
| Institutions en PLN (couverte) : | | | |
| Distribution | S/O | S/O | PLN 95 531 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 9 927 |
| VNI par action | S/O | S/O | PLN 9,62 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | |
| Capitalisation | SGD 24 108 | SGD 31 394 | SGD 32 296 |
| Actions émises en circulation | 2 217 | 3 178 | 2 703 |
| VNI par action | SGD 10,87 | SGD 9,88 | SGD 11,95 |
| Investisseurs : | | | |
| Capitalisation | \$ 4 491 | \$ 3 988 | \$ 7 210 |
| Actions émises en circulation | 96 | 95 | 142 |
| VNI par action | \$ 46,80 | \$ 42,01 | \$ 50,84 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 3 537 | € 3 248 | € 4 103 |
| Actions émises en circulation | 398 | 398 | 406 |
| VNI par action | € 8,88 | € 8,16 | € 10,11 |
| Administrations : | | | |
| Capitalisation | \$ 30 109 | \$ 22 981 | \$ 34 503 |
| Actions émises en circulation | 659 | 560 | 693 |
| VNI par action | \$ 45,68 | \$ 41,06 | \$ 49,77 |
| BM Détail : | | | |
| Décumulation | \$ 10 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | \$ 9,94 | S/O | S/O |
| Distribution II | \$ 862 | \$ 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 92 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 9,35 | \$ 9,11 | S/O |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 135 062 | \$ 114 186 | \$ 165 453 |
| Actions émises en circulation | 3 131 | 2 933 | 3 492 |
| VNI par action | \$ 43,14 | \$ 38,93 | \$ 47,38 |
| Distribution | \$ 66 773 | \$ 61 547 | \$ 109 051 |
| Actions émises en circulation | 7 136 | 6 932 | 9 691 |
| VNI par action | \$ 9,36 | \$ 8,88 | \$ 11,25 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 134 655 | € 125 229 | € 187 716 |
| Actions émises en circulation | 4 082 | 4 112 | 4 943 |
| VNI par action | € 32,99 | € 30,46 | € 37,98 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | |
| Capitalisation | SGD 9 601 | SGD 10 020 | SGD 11 604 |
| Actions émises en circulation | 159 | 181 | 172 |
| VNI par action | SGD 60,26 | SGD 55,23 | SGD 67,40 |
| H Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 417 764 | \$ 302 479 | \$ 284 247 |
| Actions émises en circulation | 8 507 | 6 875 | 5 348 |
| VNI par action | \$ 49,11 | \$ 44,00 | \$ 53,15 |
| Distribution | \$ 272 | \$ 217 | \$ 275 |
| Actions émises en circulation | 34 | 29 | 29 |
| VNI par action | \$ 7,96 | \$ 7,55 | \$ 9,57 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|---|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite) | | | |
| M Détail : | | | |
| Décumulation | \$ 10 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | \$ 9,94 | S/O | S/O |
| Distribution | \$ 8 479 | \$ 8 675 | \$ 12 295 |
| Actions émises en circulation | 1 006 | 1 085 | 1 214 |
| VNI par action | \$ 8,43 | \$ 8,00 | \$ 10,13 |
| Distribution II | \$ 4 243 | \$ 3 190 | \$ 3 720 |
| Actions émises en circulation | 606 | 473 | 428 |
| VNI par action | \$ 7,00 | \$ 6,75 | \$ 8,68 |
| M Détail en AUD (couverte) : | | | |
| Distribution | AUD 5 240 | AUD 1 510 | AUD 7 264 |
| Actions émises en circulation | 702 | 209 | 784 |
| VNI par action | AUD 7,47 | AUD 7,22 | AUD 9,27 |
| Catégorie Z : | | | |
| Distribution | \$ 19 360 | \$ 5 279 | \$ 6 317 |
| Actions émises en circulation | 1 876 | 540 | 509 |
| VNI par action | \$ 10,32 | \$ 9,78 | \$ 12,41 |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 2 693 921 | \$ 2 492 475 | \$ 2 635 769 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 714 848 | \$ 640 128 | \$ 650 604 |
| Actions émises en circulation | 45 724 | 45 303 | 37 005 |
| VNI par action | \$ 15,63 | \$ 14,13 | \$ 17,58 |
| Distribution | \$ 276 510 | \$ 306 128 | \$ 305 572 |
| Actions émises en circulation | 34 964 | 40 679 | 31 166 |
| VNI par action | \$ 7,91 | \$ 7,53 | \$ 9,80 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | |
| Capitalisation | CHF 257 904 | CHF 53 384 | CHF 50 716 |
| Actions émises en circulation | 31 142 | 6 825 | 5 067 |
| VNI par action | CHF 8,28 | CHF 7,82 | CHF 10,01 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 915 574 | € 1 011 465 | € 999 329 |
| Actions émises en circulation | 87 099 | 104 063 | 80 567 |
| VNI par action | € 10,51 | € 9,72 | € 12,40 |
| Distribution | € 146 989 | € 132 184 | € 192 797 |
| Actions émises en circulation | 21 564 | 19 921 | 21 737 |
| VNI par action | € 6,82 | € 6,64 | € 8,87 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | |
| Distribution | £ 108 520 | £ 162 630 | £ 80 974 |
| Actions émises en circulation | 14 385 | 22 478 | 8 479 |
| VNI par action | £ 7,54 | £ 7,24 | £ 9,55 |
| Institutions en GBP (non couverte) : | | | |
| Distribution | £ 5 452 | £ 3 960 | £ 3 657 |
| Actions émises en circulation | 692 | 499 | 398 |
| VNI par action | £ 7,88 | £ 7,94 | £ 9,19 |
| Investisseurs en NOK (couverte) : | | | |
| Capitalisation | NOK 4 544 | NOK 5 222 | NOK 6 610 |
| Actions émises en circulation | 40 | 50 | 50 |
| VNI par action | NOK 112,37 | NOK 103,95 | NOK 131,59 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|--|--------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite) | | | | | |
| Investisseurs en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 27 789 | SEK | 27 736 | SEK | 10 725 |
| Actions émises en circulation | | 271 | | 292 | | 89 |
| VNI par action | SEK | 102,52 | SEK | 95,02 | SEK | 121,06 |
| Administrations : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 345 | \$ | 314 | \$ | 632 |
| Actions émises en circulation | | 37 | | 37 | | 59 |
| VNI par action | \$ | 9,39 | \$ | 8,53 | \$ | 10,67 |
| Distribution | \$ | 755 | \$ | 718 | \$ | 992 |
| Actions émises en circulation | | 95 | | 95 | | 101 |
| VNI par action | \$ | 7,91 | \$ | 7,53 | \$ | 9,81 |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 250 | SEK | 105 | SEK | 85 |
| Actions émises en circulation | | 3 | | 1 | | 1 |
| VNI par action | SEK | 83,60 | SEK | 77,61 | SEK | 99,05 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 3 444 | \$ | 924 | \$ | 1 531 |
| Actions émises en circulation | | 407 | | 120 | | 158 |
| VNI par action | \$ | 8,46 | \$ | 7,71 | \$ | 9,68 |
| Distribution | \$ | 512 | \$ | 676 | \$ | 868 |
| Actions émises en circulation | | 67 | | 94 | | 92 |
| VNI par action | \$ | 7,59 | \$ | 7,23 | \$ | 9,41 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 58 741 | € | 57 844 | € | 129 837 |
| Actions émises en circulation | | 6 460 | | 6 822 | | 11 895 |
| VNI par action | € | 9,09 | € | 8,48 | € | 10,92 |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 3 909 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 353 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 11,06 | | S/O | | S/O |
| Actifs nets | | | | | | |
| | | | | | | |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 12 120 | \$ | 8 279 | \$ | 9 507 |
| Actions émises en circulation | | 733 | | 535 | | 532 |
| VNI par action | \$ | 16,54 | \$ | 15,48 | \$ | 17,88 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 90 459 | € | 102 077 | € | 113 058 |
| Actions émises en circulation | | 6 680 | | 7 881 | | 7 392 |
| VNI par action | € | 13,54 | € | 12,95 | € | 15,29 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 11 521 | \$ | 15 703 | \$ | 22 756 |
| Actions émises en circulation | | 930 | | 1 342 | | 1 668 |
| VNI par action | \$ | 12,39 | \$ | 11,70 | \$ | 13,64 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 8 772 | CHF | 10 121 | CHF | 14 255 |
| Actions émises en circulation | | 895 | | 1 048 | | 1 235 |
| VNI par action | CHF | 9,80 | CHF | 9,66 | CHF | 11,54 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 21 477 | € | 23 540 | € | 32 022 |
| Actions émises en circulation | | 1 824 | | 2 072 | | 2 365 |
| VNI par action | € | 11,78 | € | 11,36 | € | 13,54 |
| Actifs nets | | | | | | |
| | | | | | | |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 64 011 | \$ | 25 166 | \$ | 48 615 |
| Actions émises en circulation | | 5 588 | | 2 449 | | 4 383 |
| VNI par action | \$ | 11,46 | \$ | 10,28 | \$ | 11,09 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|---|---|---------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 77 402 | € | 72 560 | € | 212 680 |
| Actions émises en circulation | | 7 282 | | 7 427 | | 19 839 |
| VNI par action | € | 10,63 | € | 9,77 | € | 10,72 |
| Institutions en GBP (partiellement couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ | 829 | £ | 760 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 85 | | 81 | | S/O |
| VNI par action | £ | 9,70 | £ | 9,37 | | S/O |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 11 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,78 | | S/O | | S/O |
| Distribution | \$ | 11 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,65 | | S/O | | S/O |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 759 | € | 9 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 75 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | € | 10,12 | € | 9,38 | | S/O |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 131 360 | \$ | 101 602 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 11 634 | | 10 102 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 11,29 | \$ | 10,06 | | S/O |
| Actifs nets | | | | | | |
| | | | | | | |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | \$ | 114 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 8 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 14,02 |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 6 118 | € | 6 154 | € | 10 250 |
| Actions émises en circulation | | 408 | | 437 | | 743 |
| VNI par action | € | 14,99 | € | 14,08 | € | 13,80 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 4 075 | \$ | 4 388 | \$ | 5 195 |
| Actions émises en circulation | | 315 | | 371 | | 417 |
| VNI par action | \$ | 12,93 | \$ | 11,84 | \$ | 12,47 |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 8 249 | € | 9 351 | € | 11 252 |
| Actions émises en circulation | | 586 | | 700 | | 852 |
| VNI par action | € | 14,09 | € | 13,36 | € | 13,20 |
| Actifs nets | | | | | | |
| | | | | | | |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 44 067 | \$ | 23 414 | \$ | 5 465 |
| Actions émises en circulation | | 4 416 | | 2 486 | | 541 |
| VNI par action | \$ | 9,98 | \$ | 9,42 | \$ | 10,10 |
| Distribution | \$ | 6 | \$ | 3 575 | \$ | 3 756 |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 393 | | 375 |
| VNI par action | \$ | 9,28 | \$ | 9,10 | \$ | 10,02 |
| Institutions en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 71 681 | AUD | 57 036 | AUD | 14 |
| Actions émises en circulation | | 7 954 | | 6 338 | | 1 |
| VNI par action | AUD | 9,01 | AUD | 9,00 | AUD | 10,00 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 1 264 | CHF | 7 316 | CHF | 692 |
| Actions émises en circulation | | 137 | | 803 | | 69 |
| VNI par action | CHF | 9,24 | CHF | 9,11 | CHF | 10,02 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|-------------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 43 366 | € | 105 509 | € | 72 025 |
| Actions émises en circulation | | 4 567 | | 11 509 | | 7 175 |
| VNI par action | € | 9,50 | € | 9,17 | € | 10,04 |
| Distribution | € | 42 423 | € | 1 925 | € | 223 |
| Actions émises en circulation | | 4 808 | | 217 | | 22 |
| VNI par action | € | 8,82 | € | 8,85 | € | 9,95 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ | 382 | £ | 405 | £ | 482 |
| Actions émises en circulation | | 42 | | 44 | | 48 |
| VNI par action | £ | 9,10 | £ | 9,00 | £ | 9,98 |
| Institutions en NOK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | NOK | 286 985 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 2 768 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | NOK | 103,69 | | S/O | | S/O |
| Institutions en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 177 546 | SEK | 122 486 | SEK | 77 208 |
| Actions émises en circulation | | 1 868 | | 1 335 | | 772 |
| VNI par action | SEK | 95,05 | SEK | 91,73 | SEK | 99,96 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 411 | SGD | 367 | SGD | 366 |
| Actions émises en circulation | | 45 | | 40 | | 36 |
| VNI par action | SGD | 9,13 | SGD | 9,09 | SGD | 10,02 |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 52 396 | SEK | 79 369 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 523 | | 816 | | S/O |
| VNI par action | SEK | 100,24 | SEK | 97,22 | | S/O |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 2 429 | \$ | 1 433 | \$ | 285 |
| Actions émises en circulation | | 249 | | 155 | | 28 |
| VNI par action | \$ | 9,74 | \$ | 9,28 | \$ | 10,04 |
| Distribution | \$ | 444 | \$ | 387 | \$ | 20 |
| Actions émises en circulation | | 48 | | 43 | | 2 |
| VNI par action | \$ | 9,25 | \$ | 9,10 | \$ | 10,01 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | CHF | 9 | CHF | 9 | CHF | 9 |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | 1 |
| VNI par action | CHF | 8,57 | CHF | 8,81 | CHF | 9,94 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 6 379 | € | 4 811 | € | 1 113 |
| Actions émises en circulation | | 691 | | 535 | | 112 |
| VNI par action | € | 9,23 | € | 8,99 | € | 9,94 |
| Distribution | € | 1 798 | € | 1 016 | € | 256 |
| Actions émises en circulation | | 204 | | 115 | | 26 |
| VNI par action | € | 8,81 | € | 8,86 | € | 9,96 |
| Catégorie R en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 26 623 | AUD | 31 770 | AUD | 29 726 |
| Actions émises en circulation | | 2 955 | | 3 530 | | 2 973 |
| VNI par action | AUD | 9,01 | AUD | 9,00 | AUD | 10,00 |
| Fonds Euro Bond Fund | | | | | | |
| Actifs nets | € | 1 671 713 | € | 1 913 275 | € | 2 574 129 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 1 122 219 | € | 1 386 127 | € | 1 926 406 |
| Actions émises en circulation | | 48 219 | | 64 252 | | 73 731 |
| VNI par action | € | 23,27 | € | 21,57 | € | 26,13 |
| Distribution | € | 31 807 | € | 68 589 | € | 92 872 |
| Actions émises en circulation | | 2 175 | | 4 956 | | 5 474 |
| VNI par action | € | 14,63 | € | 13,84 | € | 16,97 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|-------------------------------------|------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Euro Bond Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 327 426 | CHF | 313 292 | CHF | 351 467 |
| Actions émises en circulation | | 10 517 | | 10 631 | | 9 789 |
| VNI par action | CHF | 31,13 | CHF | 29,47 | CHF | 35,91 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 20 023 | € | 16 885 | € | 23 320 |
| Actions émises en circulation | | 927 | | 841 | | 956 |
| VNI par action | € | 21,59 | € | 20,08 | € | 24,41 |
| Distribution | | S/O | | S/O | € | 236 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 15 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 16,28 |
| Administrations : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | € | 2 579 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 110 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 23,48 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 120 775 | € | 101 050 | € | 151 006 |
| Actions émises en circulation | | 6 094 | | 5 451 | | 6 666 |
| VNI par action | € | 19,82 | € | 18,54 | € | 22,65 |
| Distribution | € | 24 717 | € | 23 340 | € | 38 508 |
| Actions émises en circulation | | 2 342 | | 2 337 | | 3 146 |
| VNI par action | € | 10,55 | € | 9,99 | € | 12,24 |
| Fonds Euro Credit Fund | | | | | | |
| Actifs nets | € | 537 186 | € | 610 008 | € | 1 017 163 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 347 915 | € | 348 784 | € | 743 335 |
| Actions émises en circulation | | 22 389 | | 24 516 | | 43 513 |
| VNI par action | € | 15,54 | € | 14,23 | € | 17,08 |
| Distribution II | € | 6 860 | € | 16 940 | € | 80 562 |
| Actions émises en circulation | | 719 | | 1 879 | | 7 303 |
| VNI par action | € | 9,54 | € | 9,02 | € | 11,03 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 40 494 | € | 11 194 | € | 18 325 |
| Actions émises en circulation | | 3 346 | | 1 001 | | 1 353 |
| VNI par action | € | 12,10 | € | 11,18 | € | 13,54 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 141 817 | € | 232 926 | € | 173 091 |
| Actions émises en circulation | | 15 125 | | 27 156 | | 16 823 |
| VNI par action | € | 9,38 | € | 8,58 | € | 10,29 |
| Distribution II | € | 100 | € | 164 | € | 1 850 |
| Actions émises en circulation | | 11 | | 20 | | 186 |
| VNI par action | € | 8,68 | € | 8,14 | € | 9,93 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | | | | | | |
| Actifs nets | € | 1 387 227 | € | 1 352 980 | € | 2 482 304 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 323 024 | € | 332 727 | € | 895 043 |
| Actions émises en circulation | | 21 389 | | 23 944 | | 56 691 |
| VNI par action | € | 15,10 | € | 13,90 | € | 15,79 |
| Distribution | € | 65 612 | € | 79 523 | € | 128 548 |
| Actions émises en circulation | | 6 705 | | 8 533 | | 11 833 |
| VNI par action | € | 9,79 | € | 9,32 | € | 10,86 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 14 845 | € | 10 138 | € | 14 129 |
| Actions émises en circulation | | 1 536 | | 1 136 | | 1 388 |
| VNI par action | € | 9,67 | € | 8,93 | € | 10,18 |
| Distribution | € | 8 086 | € | 8 520 | € | 10 907 |
| Actions émises en circulation | | 851 | | 939 | | 1 027 |
| VNI par action | € | 9,50 | € | 9,08 | € | 10,62 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Euro Income Bond Fund (suite) | | | |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | € 573 864 | € 540 713 | € 856 874 |
| Actions émises en circulation | 42 654 | 43 285 | 59 839 |
| VNI par action | € 13,45 | € 12,49 | € 14,32 |
| Distribution | € 359 021 | € 347 514 | € 527 452 |
| Actions émises en circulation | 41 468 | 41 763 | 53 871 |
| VNI par action | € 8,66 | € 8,32 | € 9,79 |
| Distribution Q | S/O | S/O | € 3 868 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 406 |
| VNI par action | S/O | S/O | € 9,53 |
| Catégorie T : | | | |
| Capitalisation | € 30 390 | € 24 746 | € 32 571 |
| Actions émises en circulation | 2 946 | 2 573 | 2 943 |
| VNI par action | € 10,32 | € 9,62 | € 11,07 |
| Distribution | € 12 385 | € 9 099 | € 12 914 |
| Actions émises en circulation | 1 620 | 1 234 | 1 482 |
| VNI par action | € 7,64 | € 7,38 | € 8,72 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | | | |
| Actifs nets | € 923 969 | € 110 048 | € 160 601 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | € 923 958 | € 110 048 | € 160 601 |
| Actions émises en circulation | 44 105 | 5 786 | 5 426 |
| VNI par action | € 20,95 | € 19,02 | € 29,60 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | € 11 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | € 11,33 | S/O | S/O |
| Fonds Euro Short-Term Fund | | | |
| Actifs nets | € 193 514 | € 353 095 | € 629 859 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | € 165 347 | € 339 031 | € 616 693 |
| Actions émises en circulation | 13 404 | 28 689 | 51 558 |
| VNI par action | € 12,34 | € 11,82 | € 11,96 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | € 28 167 | € 14 064 | € 13 166 |
| Actions émises en circulation | 2 608 | 1 350 | 1 239 |
| VNI par action | € 10,80 | € 10,42 | € 10,63 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | | |
| Actifs nets | € 367 767 | € 174 162 | € 170 489 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | € 219 781 | € 32 875 | € 12 500 |
| Actions émises en circulation | 19 847 | 3 379 | 1 159 |
| VNI par action | € 11,07 | € 9,73 | € 10,79 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | € 4 061 | € 10 | S/O |
| Actions émises en circulation | 360 | 1 | S/O |
| VNI par action | € 11,28 | € 10,00 | S/O |
| Distribution | € 10 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | € 10,61 | S/O | S/O |
| Catégorie Z : | | | |
| Capitalisation | € 143 915 | € 141 277 | € 157 989 |
| Actions émises en circulation | 12 727 | 14 301 | 14 501 |
| VNI par action | € 11,31 | € 9,88 | € 10,90 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|---|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | | | |
| Actifs nets | € 130 610 | € 211 172 | € 395 491 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | € 67 680 | € 127 942 | € 254 925 |
| Actions émises en circulation | 5 907 | 11 637 | 22 466 |
| VNI par action | € 11,46 | € 10,99 | € 11,35 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | € 11 471 | € 7 775 | € 4 368 |
| Actions émises en circulation | 1 175 | 826 | 447 |
| VNI par action | € 9,77 | € 9,42 | € 9,77 |
| H Institutions : | | | |
| Capitalisation | € 51 459 | € 75 455 | € 136 198 |
| Actions émises en circulation | 5 184 | 7 907 | 13 806 |
| VNI par action | € 9,93 | € 9,54 | € 9,87 |
| Fonds Global Advantage Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 432 290 | \$ 410 459 | \$ 521 067 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 7 698 | \$ 7 716 | \$ 24 968 |
| Actions émises en circulation | 540 | 582 | 1 630 |
| VNI par action | \$ 14,26 | \$ 13,28 | \$ 15,32 |
| Institutions en CHF (partiellement couverte) : | | | |
| Distribution | CHF 108 735 | CHF 111 046 | CHF 132 681 |
| Actions émises en circulation | 12 443 | 12 487 | 12 823 |
| VNI par action | CHF 8,74 | CHF 8,89 | CHF 10,35 |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 206 079 | € 203 446 | € 237 602 |
| Actions émises en circulation | 15 268 | 15 828 | 16 656 |
| VNI par action | € 13,50 | € 12,85 | € 14,26 |
| Institutions en GBP (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | S/O | S/O | £ 182 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 14 |
| VNI par action | S/O | S/O | £ 13,42 |
| Institutions en NOK (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | NOK 620 678 | NOK 577 381 | NOK 625 501 |
| Actions émises en circulation | 4 106 | 4 099 | 4 093 |
| VNI par action | NOK 151,18 | NOK 140,84 | NOK 152,81 |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 6 009 | € 6 540 | € 8 002 |
| Actions émises en circulation | 509 | 576 | 629 |
| VNI par action | € 11,80 | € 11,36 | € 12,73 |
| Fonds Global Bond Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 13 077 262 | \$ 11 420 112 | \$ 14 038 846 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 4 616 460 | \$ 3 410 090 | \$ 3 999 850 |
| Actions émises en circulation | 134 931 | 107 593 | 111 904 |
| VNI par action | \$ 34,21 | \$ 31,69 | \$ 35,74 |
| Distribution | \$ 210 566 | \$ 172 513 | \$ 203 191 |
| Actions émises en circulation | 11 420 | 9 898 | 10 136 |
| VNI par action | \$ 18,44 | \$ 17,43 | \$ 20,05 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|---|--------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | | | | | |
| Institutions (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 307 999 | \$ | 326 665 | \$ | 328 710 |
| Actions émises en circulation | | 9 940 | | 11 261 | | 9 512 |
| VNI par action | \$ | 30,99 | \$ | 29,01 | \$ | 34,56 |
| Distribution | \$ | 19 480 | \$ | 19 875 | \$ | 26 341 |
| Actions émises en circulation | | 1 011 | | 1 080 | | 1 178 |
| VNI par action | \$ | 19,27 | \$ | 18,41 | \$ | 22,37 |
| Institutions en CAD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CAD | 50 875 | CAD | 54 563 | CAD | 72 089 |
| Actions émises en circulation | | 4 696 | | 5 395 | | 6 309 |
| VNI par action | CAD | 10,83 | CAD | 10,11 | CAD | 11,43 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 365 291 | CHF | 440 925 | CHF | 552 547 |
| Actions émises en circulation | | 11 784 | | 14 706 | | 15 928 |
| VNI par action | CHF | 31,00 | CHF | 29,98 | CHF | 34,69 |
| Distribution | CHF | 142 984 | CHF | 175 781 | CHF | 218 701 |
| Actions émises en circulation | | 8 104 | | 10 095 | | 10 645 |
| VNI par action | CHF | 17,64 | CHF | 17,41 | CHF | 20,54 |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 191 275 | € | 190 480 | € | 139 337 |
| Actions émises en circulation | | 14 411 | | 14 810 | | 9 692 |
| VNI par action | € | 13,27 | € | 12,86 | € | 14,38 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 1 986 158 | € | 1 974 600 | € | 2 453 258 |
| Actions émises en circulation | | 74 563 | | 78 287 | | 84 453 |
| VNI par action | € | 26,64 | € | 25,22 | € | 29,05 |
| Distribution | € | 597 513 | € | 512 652 | € | 628 774 |
| Actions émises en circulation | | 36 436 | | 32 355 | | 33 781 |
| VNI par action | € | 16,40 | € | 15,84 | € | 18,61 |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 2 186 | £ | 3 343 | £ | 3 600 |
| Actions émises en circulation | | 203 | | 313 | | 319 |
| VNI par action | £ | 10,76 | £ | 10,68 | £ | 11,30 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 189 318 | £ | 162 896 | £ | 198 000 |
| Actions émises en circulation | | 8 545 | | 7 879 | | 8 429 |
| VNI par action | £ | 22,16 | £ | 20,68 | £ | 23,49 |
| Distribution | £ | 117 923 | £ | 132 242 | £ | 191 729 |
| Actions émises en circulation | | 9 288 | | 10 904 | | 13 574 |
| VNI par action | £ | 12,70 | £ | 12,13 | £ | 14,13 |
| Institutions en ILS (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | ILS | 304 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 18 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | ILS | 16,75 |
| Institutions en NOK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | NOK | 2 483 411 | NOK | 2 918 045 | NOK | 4 130 842 |
| Actions émises en circulation | | 11 421 | | 14 215 | | 17 688 |
| VNI par action | NOK | 217,44 | NOK | 205,28 | NOK | 233,55 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|---|--------------------------------|---------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en NZD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | NZD | 148 154 | NZD | 167 929 | NZD | 309 397 |
| Actions émises en circulation | | 3 487 | | 4 162 | | 6 643 |
| VNI par action | NZD | 42,48 | NZD | 40,35 | NZD | 46,57 |
| Institutions en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 458 269 | SEK | 1 120 588 | SEK | 1 219 998 |
| Actions émises en circulation | | 2 212 | | 5 712 | | 5 426 |
| VNI par action | SEK | 207,22 | SEK | 196,17 | SEK | 224,86 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 229 722 | SGD | 217 237 | SGD | 174 944 |
| Actions émises en circulation | | 12 592 | | 12 665 | | 9 030 |
| VNI par action | SGD | 18,24 | SGD | 17,15 | SGD | 19,37 |
| Distribution | SGD | 115 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 11 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | SGD | 10,33 | | S/O | | S/O |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 201 431 | \$ | 94 643 | \$ | 135 136 |
| Actions émises en circulation | | 6 417 | | 3 244 | | 4 092 |
| VNI par action | \$ | 31,39 | \$ | 29,18 | \$ | 33,02 |
| Distribution | \$ | 54 670 | \$ | 28 517 | \$ | 7 773 |
| Actions émises en circulation | | 3 529 | | 1 948 | | 462 |
| VNI par action | \$ | 15,49 | \$ | 14,64 | \$ | 16,84 |
| Investisseurs (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | \$ | 2 315 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 71 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 32,58 |
| Investisseurs en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 125 907 | CHF | 145 814 | CHF | 188 770 |
| Actions émises en circulation | | 10 594 | | 12 641 | | 14 095 |
| VNI par action | CHF | 11,88 | CHF | 11,53 | CHF | 13,39 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 84 542 | € | 75 495 | € | 92 541 |
| Actions émises en circulation | | 3 393 | | 3 189 | | 3 382 |
| VNI par action | € | 24,92 | € | 23,68 | € | 27,36 |
| Investisseurs en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 6 747 | £ | 5 437 | £ | 5 846 |
| Actions émises en circulation | | 325 | | 280 | | 264 |
| VNI par action | £ | 20,77 | £ | 19,45 | £ | 22,17 |
| Investisseurs en NOK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | NOK | 62 521 | NOK | 23 662 | NOK | 28 765 |
| Actions émises en circulation | | 306 | | 122 | | 130 |
| VNI par action | NOK | 204,47 | NOK | 193,71 | NOK | 221,16 |
| Administrations : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 13 375 | \$ | 9 565 | \$ | 15 922 |
| Actions émises en circulation | | 439 | | 337 | | 495 |
| VNI par action | \$ | 30,48 | \$ | 28,38 | \$ | 32,16 |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 124 505 | SEK | 114 069 | SEK | 1 941 |
| Actions émises en circulation | | 1 376 | | 1 325 | | 20 |
| VNI par action | SEK | 90,48 | SEK | 86,08 | SEK | 99,17 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|--------------------------------|---------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | | | | | |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 369 607 | \$ | 326 703 | \$ | 463 700 |
| Actions émises en circulation | | 12 696 | | 12 006 | | 14 974 |
| VNI par action | \$ | 29,11 | \$ | 27,21 | \$ | 30,97 |
| Distribution | \$ | 143 056 | \$ | 101 393 | \$ | 117 421 |
| Actions émises en circulation | | 10 742 | | 8 054 | | 8 111 |
| VNI par action | \$ | 13,32 | \$ | 12,59 | \$ | 14,48 |
| Catégorie E (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 38 405 | \$ | 34 705 | \$ | 61 145 |
| Actions émises en circulation | | 3 130 | | 2 994 | | 4 389 |
| VNI par action | \$ | 12,27 | \$ | 11,59 | \$ | 13,93 |
| Distribution | \$ | 19 849 | \$ | 13 040 | \$ | 16 440 |
| Actions émises en circulation | | 1 925 | | 1 324 | | 1 374 |
| VNI par action | \$ | 10,31 | \$ | 9,85 | \$ | 11,97 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 2 398 | CHF | 1 921 | CHF | 2 358 |
| Actions émises en circulation | | 262 | | 215 | | 226 |
| VNI par action | CHF | 9,14 | CHF | 8,92 | CHF | 10,41 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 698 781 | € | 685 427 | € | 959 543 |
| Actions émises en circulation | | 30 821 | | 31 641 | | 38 117 |
| VNI par action | € | 22,67 | € | 21,66 | € | 25,17 |
| Distribution | € | 40 788 | € | 31 423 | € | 41 846 |
| Actions émises en circulation | | 4 531 | | 3 613 | | 4 097 |
| VNI par action | € | 9,00 | € | 8,70 | € | 10,22 |
| Catégorie E en NOK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | NOK | 85 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | NOK | 99,69 |
| G Détail en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | € | 68 720 | € | 66 161 | € | 123 034 |
| Actions émises en circulation | | 7 568 | | 7 543 | | 11 955 |
| VNI par action | € | 9,08 | € | 8,77 | € | 10,29 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 743 816 | \$ | 752 379 | \$ | 835 136 |
| Actions émises en circulation | | 22 522 | | 24 551 | | 24 124 |
| VNI par action | \$ | 33,03 | \$ | 30,65 | \$ | 34,62 |
| Distribution | \$ | 2 227 | \$ | 2 035 | \$ | 2 643 |
| Actions émises en circulation | | 239 | | 231 | | 261 |
| VNI par action | \$ | 9,30 | \$ | 8,79 | \$ | 10,11 |
| H Institutions (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 150 642 | \$ | 309 569 | \$ | 756 |
| Actions émises en circulation | | 17 281 | | 37 885 | | 78 |
| VNI par action | \$ | 8,72 | \$ | 8,17 | \$ | 9,75 |
| M Détail : | | | | | | |
| Distribution II | \$ | 854 | \$ | 1 358 | \$ | 1 742 |
| Actions émises en circulation | | 92 | | 153 | | 168 |
| VNI par action | \$ | 9,27 | \$ | 8,89 | \$ | 10,34 |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | HKD | 18 703 | HKD | 5 118 | HKD | 8 307 |
| Actions émises en circulation | | 2 013 | | 575 | | 802 |
| VNI par action | HKD | 9,29 | HKD | 8,91 | HKD | 10,35 |
| M Détail en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | SEK | 90 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | SEK | 99,56 |
| M Détail en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | SGD | 13 975 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 370 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | SGD | 10,20 | | S/O | | S/O |
| Catégorie R en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 6 081 | € | 5 591 | € | 6 442 |
| Actions émises en circulation | | 547 | | 530 | | 528 |
| VNI par action | € | 11,12 | € | 10,56 | € | 12,19 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|---|--------------------------------|---------|------------------------|--------|------------------------|--------|
| | Fonds Global Bond Fund (suite) | | | | | |
| Catégorie T : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 17 137 | \$ | 15 814 | \$ | 26 245 |
| Actions émises en circulation | | 1 511 | | 1 487 | | 2 163 |
| VNI par action | \$ | 11,34 | \$ | 10,63 | \$ | 12,14 |
| Distribution | \$ | 5 367 | \$ | 3 040 | \$ | 4 183 |
| Actions émises en circulation | | 506 | | 303 | | 362 |
| VNI par action | \$ | 10,61 | \$ | 10,04 | \$ | 11,54 |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 24 878 | € | 14 560 | € | 19 104 |
| Actions émises en circulation | | 2 566 | | 1 567 | | 1 764 |
| VNI par action | € | 9,70 | € | 9,29 | € | 10,83 |
| Catégorie W : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 118 273 | \$ | 24 415 | \$ | 29 951 |
| Actions émises en circulation | | 12 197 | | 2 721 | | 2 962 |
| VNI par action | \$ | 9,70 | \$ | 8,97 | \$ | 10,11 |
| Distribution | \$ | 54 179 | \$ | 9 498 | \$ | 9 066 |
| Actions émises en circulation | | 5 964 | | 1 106 | | 919 |
| VNI par action | \$ | 9,08 | \$ | 8,59 | \$ | 9,87 |
| Distribution II | \$ | 529 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 51 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,43 | | S/O | | S/O |
| Catégorie W (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | \$ | 10 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 10,00 |
| Distribution | | S/O | | S/O | \$ | 10 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 9,77 |
| Catégorie W en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 32 887 | CHF | 24 828 | CHF | 33 361 |
| Actions émises en circulation | | 3 691 | | 2 884 | | 3 352 |
| VNI par action | CHF | 8,91 | CHF | 8,61 | CHF | 9,95 |
| Distribution | CHF | 4 389 | CHF | 705 | CHF | 740 |
| Actions émises en circulation | | 526 | | 86 | | 76 |
| VNI par action | CHF | 8,34 | CHF | 8,24 | CHF | 9,72 |
| Catégorie W en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 23 248 | € | 9 594 | € | 14 976 |
| Actions émises en circulation | | 2 535 | | 1 106 | | 1 500 |
| VNI par action | € | 9,17 | € | 8,68 | € | 9,98 |
| Distribution | € | 4 237 | € | 2 352 | € | 2 251 |
| Actions émises en circulation | | 493 | | 283 | | 231 |
| VNI par action | € | 8,59 | € | 8,30 | € | 9,75 |
| Catégorie W en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 16 595 | £ | 2 383 | £ | 1 265 |
| Actions émises en circulation | | 1 743 | | 268 | | 126 |
| VNI par action | £ | 9,52 | £ | 8,88 | £ | 10,08 |
| Distribution | £ | 8 538 | £ | 5 877 | £ | 9 060 |
| Actions émises en circulation | | 957 | | 692 | | 921 |
| VNI par action | £ | 8,92 | £ | 8,49 | £ | 9,84 |
| Catégorie W en NOK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | NOK | 11 384 | NOK | 4 083 | NOK | 3 799 |
| Actions émises en circulation | | 122 | | 46 | | 38 |
| VNI par action | NOK | 93,68 | NOK | 88,35 | NOK | 100,41 |
| Catégorie W en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | SEK | 89 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | SEK | 100,33 |
| Catégorie W en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution II | SGD | 10 799 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 049 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | SGD | 10,30 | | S/O | | S/O |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au | | Au | | Au | |
|--|-----------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2021 | 31 décembre 2021 | 31 décembre 2021 |
| | Fonds Global Bond ESG Fund | | | | | |
| Actifs nets | \$ 3 561 180 | \$ 3 106 190 | \$ 3 106 190 | \$ 2 302 966 | | |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ 365 875 | \$ 366 227 | \$ 366 227 | \$ 300 944 | | |
| Actions émises en circulation | 32 142 | 34 584 | 34 584 | 25 077 | | |
| VNI par action | \$ 11,38 | \$ 10,59 | \$ 10,59 | \$ 12,00 | | |
| Distribution | \$ 47 502 | \$ 65 549 | \$ 65 549 | \$ 25 309 | | |
| Actions émises en circulation | 4 956 | 7 213 | 7 213 | 2 428 | | |
| VNI par action | \$ 9,58 | \$ 9,09 | \$ 9,09 | \$ 10,43 | | |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF 599 209 | CHF 454 679 | CHF 454 679 | CHF 22 579 | | |
| Actions émises en circulation | 63 416 | 49 550 | 49 550 | 2 115 | | |
| VNI par action | CHF 9,45 | CHF 9,18 | CHF 9,18 | CHF 10,67 | | |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | S/O | € 3 933 | € 3 933 | € 856 | | |
| Actions émises en circulation | S/O | 444 | 444 | 86 | | |
| VNI par action | S/O | € 8,85 | € 8,85 | € 9,96 | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € 928 944 | € 957 548 | € 957 548 | € 623 870 | | |
| Actions émises en circulation | 94 043 | 101 940 | 101 940 | 57 390 | | |
| VNI par action | € 9,88 | € 9,39 | € 9,39 | € 10,87 | | |
| Distribution | € 47 447 | € 92 352 | € 92 352 | € 111 407 | | |
| Actions émises en circulation | 5 326 | 10 695 | 10 695 | 11 012 | | |
| VNI par action | € 8,91 | € 8,63 | € 8,63 | € 10,12 | | |
| Institutions en GBP (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Distribution | £ 686 | £ 8 | £ 8 | S/O | | |
| Actions émises en circulation | 73 | 1 | 1 | S/O | | |
| VNI par action | £ 9,38 | £ 9,55 | £ 9,55 | S/O | | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ 101 214 | £ 2 394 | £ 2 394 | £ 16 849 | | |
| Actions émises en circulation | 10 501 | 266 | 266 | 1 634 | | |
| VNI par action | £ 9,64 | £ 9,03 | £ 9,03 | £ 10,31 | | |
| Distribution | £ 79 564 | £ 84 397 | £ 84 397 | £ 75 165 | | |
| Actions émises en circulation | 8 333 | 9 242 | 9 242 | 7 117 | | |
| VNI par action | £ 9,55 | £ 9,13 | £ 9,13 | £ 10,56 | | |
| Institutions en GBP (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ 8 646 | £ 20 996 | £ 20 996 | £ 23 387 | | |
| Actions émises en circulation | 928 | 2 240 | 2 240 | 2 448 | | |
| VNI par action | £ 9,31 | £ 9,37 | £ 9,37 | £ 9,55 | | |
| Institutions en NOK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | NOK 6 352 155 | NOK 5 366 868 | NOK 5 366 868 | NOK 5 205 593 | | |
| Actions émises en circulation | 595 694 | 531 175 | 531 175 | 450 696 | | |
| VNI par action | NOK 10,66 | NOK 10,10 | NOK 10,10 | NOK 11,55 | | |
| Institutions en NZD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | NZD 70 237 | NZD 64 722 | NZD 64 722 | NZD 74 299 | | |
| Actions émises en circulation | 6 984 | 6 755 | 6 755 | 6 732 | | |
| VNI par action | NZD 10,06 | NZD 9,58 | NZD 9,58 | NZD 11,04 | | |
| Institutions en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK 357 538 | SEK 504 943 | SEK 504 943 | SEK 568 764 | | |
| Actions émises en circulation | 3 909 | 5 807 | 5 807 | 5 678 | | |
| VNI par action | SEK 91,47 | SEK 86,95 | SEK 86,95 | SEK 100,17 | | |

| | Au | | Au | | Au | |
|--|---|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 31 décembre 2023 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2022 | 31 décembre 2021 | 31 décembre 2021 | 31 décembre 2021 |
| | Fonds Global Bond ESG Fund (suite) | | | | | |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ 12 932 | \$ 8 195 | \$ 8 195 | \$ 12 127 | | |
| Actions émises en circulation | 1 195 | 811 | 811 | 1 055 | | |
| VNI par action | \$ 10,82 | \$ 10,10 | \$ 10,10 | \$ 11,49 | | |
| Administrations : | | | | | | |
| Capitalisation | S/O | S/O | S/O | \$ 2 318 | | |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | S/O | 208 | | |
| VNI par action | S/O | S/O | S/O | \$ 11,12 | | |
| Distribution | S/O | S/O | S/O | \$ 11 | | |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | S/O | 1 | | |
| VNI par action | S/O | S/O | S/O | \$ 10,82 | | |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK 89 882 | S/O | S/O | S/O | | |
| Actions émises en circulation | 871 | S/O | S/O | S/O | | |
| VNI par action | SEK 103,14 | S/O | S/O | S/O | | |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Distribution | \$ 4 640 | \$ 3 846 | \$ 3 846 | \$ 2 115 | | |
| Actions émises en circulation | 467 | 408 | 408 | 196 | | |
| VNI par action | \$ 9,94 | \$ 9,42 | \$ 9,42 | \$ 10,81 | | |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF 1 699 | CHF 77 | CHF 77 | S/O | | |
| Actions émises en circulation | 172 | 8 | 8 | S/O | | |
| VNI par action | CHF 9,86 | CHF 9,66 | CHF 9,66 | S/O | | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € 41 956 | € 38 263 | € 38 263 | € 48 847 | | |
| Actions émises en circulation | 4 512 | 4 288 | 4 288 | 4 688 | | |
| VNI par action | € 9,30 | € 8,92 | € 8,92 | € 10,42 | | |
| Catégorie Z en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD 490 444 | AUD 356 037 | AUD 356 037 | AUD 250 833 | | |
| Actions émises en circulation | 49 785 | 37 495 | 37 495 | 22 777 | | |
| VNI par action | AUD 9,85 | AUD 9,50 | AUD 9,50 | AUD 11,01 | | |
| | Fonds Global Bond Ex-US Fund | | | | | |
| Actifs nets | \$ 800 126 | \$ 716 022 | \$ 716 022 | \$ 911 707 | | |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ 461 455 | \$ 420 156 | \$ 420 156 | \$ 527 915 | | |
| Actions émises en circulation | 18 846 | 18 790 | 18 790 | 21 249 | | |
| VNI par action | \$ 24,49 | \$ 22,36 | \$ 22,36 | \$ 24,84 | | |
| Distribution | \$ 38 610 | \$ 32 820 | \$ 32 820 | \$ 52 506 | | |
| Actions émises en circulation | 2 428 | 2 206 | 2 206 | 3 117 | | |
| VNI par action | \$ 15,90 | \$ 14,88 | \$ 14,88 | \$ 16,85 | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € 22 817 | € 45 032 | € 45 032 | € 23 841 | | |
| Actions émises en circulation | 1 329 | 2 816 | 2 816 | 1 315 | | |
| VNI par action | € 17,16 | € 15,99 | € 15,99 | € 18,13 | | |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ 6 785 | \$ 6 657 | \$ 6 657 | \$ 17 194 | | |
| Actions émises en circulation | 295 | 316 | 316 | 732 | | |
| VNI par action | \$ 22,99 | \$ 21,07 | \$ 21,07 | \$ 23,49 | | |
| Administrations : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ 10 238 | \$ 10 720 | \$ 10 720 | \$ 12 451 | | |
| Actions émises en circulation | 460 | 525 | 525 | 546 | | |
| VNI par action | \$ 22,23 | \$ 20,41 | \$ 20,41 | \$ 22,79 | | |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Distribution | \$ 42 176 | \$ 23 336 | \$ 23 336 | \$ 54 115 | | |
| Actions émises en circulation | 2 731 | 1 615 | 1 615 | 3 309 | | |
| VNI par action | \$ 15,44 | \$ 14,45 | \$ 14,45 | \$ 16,36 | | |
| Catégorie E (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Distribution | \$ 54 158 | \$ 62 837 | \$ 62 837 | \$ 81 361 | | |
| Actions émises en circulation | 6 463 | 7 858 | 7 858 | 8 142 | | |
| VNI par action | \$ 8,38 | \$ 8,00 | \$ 8,00 | \$ 9,99 | | |

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | Au 31 décembre 2021 | | |
|-----------------------------------|--------------------------------------|-----------|-----|------------------------|-----|-----------|------------------------|--|--|
| | Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite) | | | | | | | | |
| H Institutions : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 46 259 | \$ | 6 714 | \$ | 1 160 | | | |
| Actions émises en circulation | | 4 207 | | 667 | | 104 | | | |
| VNI par action | \$ | 11,00 | \$ | 10,06 | \$ | 11,20 | | | |
| Catégorie Z : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 115 239 | \$ | 104 722 | \$ | 137 893 | | | |
| Actions émises en circulation | | 10 957 | | 10 957 | | 13 049 | | | |
| VNI par action | \$ | 10,52 | \$ | 9,56 | \$ | 10,57 | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| Actifs nets | \$ | 2 980 250 | \$ | 3 102 868 | \$ | 5 169 160 | | | |
| Institutions : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 633 820 | \$ | 579 939 | \$ | 844 967 | | | |
| Actions émises en circulation | | 21 624 | | 22 368 | | 29 240 | | | |
| VNI par action | \$ | 29,31 | \$ | 25,93 | \$ | 28,90 | | | |
| Distribution | \$ | 298 704 | \$ | 292 202 | \$ | 489 734 | | | |
| Actions émises en circulation | | 28 490 | | 29 927 | | 42 937 | | | |
| VNI par action | \$ | 10,48 | \$ | 9,76 | \$ | 11,41 | | | |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 24 625 | CHF | 22 915 | CHF | 38 082 | | | |
| Actions émises en circulation | | 1 428 | | 1 439 | | 2 089 | | | |
| VNI par action | CHF | 17,24 | CHF | 15,92 | CHF | 18,23 | | | |
| Distribution | CHF | 3 467 | CHF | 3 237 | CHF | 16 630 | | | |
| Actions émises en circulation | | 454 | | 436 | | 1 863 | | | |
| VNI par action | CHF | 7,64 | CHF | 7,43 | CHF | 8,93 | | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 698 966 | € | 725 182 | € | 1 232 938 | | | |
| Actions émises en circulation | | 28 447 | | 32 640 | | 48 671 | | | |
| VNI par action | € | 24,57 | € | 22,22 | € | 25,33 | | | |
| Distribution | € | 136 798 | € | 155 150 | € | 119 724 | | | |
| Actions émises en circulation | | 13 305 | | 15 853 | | 10 243 | | | |
| VNI par action | € | 10,28 | € | 9,79 | € | 11,69 | | | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 45 376 | £ | 31 335 | £ | 239 206 | | | |
| Actions émises en circulation | | 2 749 | | 2 130 | | 14 437 | | | |
| VNI par action | £ | 16,51 | £ | 14,71 | £ | 16,57 | | | |
| Distribution | £ | 215 523 | £ | 292 800 | £ | 557 487 | | | |
| Actions émises en circulation | | 41 123 | | 59 445 | | 95 775 | | | |
| VNI par action | £ | 5,24 | £ | 4,93 | £ | 5,82 | | | |
| Investisseurs : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 2 146 | \$ | 1 820 | \$ | 12 295 | | | |
| Actions émises en circulation | | 156 | | 149 | | 902 | | | |
| VNI par action | \$ | 13,73 | \$ | 12,19 | \$ | 13,64 | | | |
| Distribution | \$ | 11 | | S/O | | S/O | | | |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O | | | |
| VNI par action | \$ | 10,72 | | S/O | | S/O | | | |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 5 450 | € | 12 416 | € | 5 703 | | | |
| Actions émises en circulation | | 232 | | 583 | | 234 | | | |
| VNI par action | € | 23,47 | € | 21,30 | € | 24,37 | | | |

| | Au 31 décembre 2023 | | | Au 31 décembre 2022 | | | Au 31 décembre 2021 | | |
|-------------------------------------|---|---------|-----|------------------------|-----|---------|------------------------|--|--|
| | Fonds Global High Yield Bond Fund (suite) | | | | | | | | |
| Administrations : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 22 199 | \$ | 30 795 | \$ | 50 855 | | | |
| Actions émises en circulation | | 818 | | 1 276 | | 1 881 | | | |
| VNI par action | \$ | 27,15 | \$ | 24,14 | \$ | 27,04 | | | |
| Distribution | \$ | 16 634 | \$ | 21 259 | \$ | 32 985 | | | |
| Actions émises en circulation | | 1 621 | | 2 225 | | 2 956 | | | |
| VNI par action | \$ | 10,26 | \$ | 9,56 | \$ | 11,16 | | | |
| Administrations en EUR (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | € | 1 908 | | | |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 196 | | | |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 9,71 | | | |
| Administrations en GBP (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | £ | 1 111 | | | |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 106 | | | |
| VNI par action | | S/O | | S/O | £ | 10,44 | | | |
| BM Détail : | | | | | | | | | |
| Distribution II | \$ | 3 173 | \$ | 10 | | S/O | | | |
| Actions émises en circulation | | 324 | | 1 | | S/O | | | |
| VNI par action | \$ | 9,78 | \$ | 9,34 | | S/O | | | |
| Catégorie E : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 123 931 | \$ | 129 353 | \$ | 186 558 | | | |
| Actions émises en circulation | | 4 939 | | 5 776 | | 7 407 | | | |
| VNI par action | \$ | 25,09 | \$ | 22,40 | \$ | 25,19 | | | |
| Distribution | \$ | 96 084 | \$ | 109 532 | \$ | 151 015 | | | |
| Actions émises en circulation | | 9 302 | | 11 389 | | 13 453 | | | |
| VNI par action | \$ | 10,33 | \$ | 9,62 | \$ | 11,23 | | | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 224 500 | € | 224 727 | € | 299 451 | | | |
| Actions émises en circulation | | 9 501 | | 10 424 | | 12 074 | | | |
| VNI par action | € | 23,63 | € | 21,56 | € | 24,80 | | | |
| Distribution | € | 27 762 | € | 27 782 | € | 38 159 | | | |
| Actions émises en circulation | | 3 303 | | 3 472 | | 3 992 | | | |
| VNI par action | € | 8,40 | € | 8,00 | € | 9,56 | | | |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | £ | 3 519 | £ | 5 932 | £ | 7 285 | | | |
| Actions émises en circulation | | 318 | | 572 | | 595 | | | |
| VNI par action | £ | 11,06 | £ | 10,38 | £ | 12,25 | | | |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | SGD | 8 215 | SGD | 6 387 | SGD | 11 731 | | | |
| Actions émises en circulation | | 865 | | 711 | | 1 116 | | | |
| VNI par action | SGD | 9,50 | SGD | 8,98 | SGD | 10,52 | | | |
| H Institutions : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 128 939 | \$ | 218 500 | \$ | 82 082 | | | |
| Actions émises en circulation | | 4 586 | | 8 771 | | 2 952 | | | |
| VNI par action | \$ | 28,12 | \$ | 24,91 | \$ | 27,81 | | | |
| Distribution | \$ | 7 523 | \$ | 4 003 | \$ | 10 759 | | | |
| Actions émises en circulation | | 809 | | 462 | | 1 064 | | | |
| VNI par action | \$ | 9,29 | \$ | 8,66 | \$ | 10,11 | | | |
| M Détail : | | | | | | | | | |
| Distribution | \$ | 16 994 | \$ | 17 710 | \$ | 25 552 | | | |
| Actions émises en circulation | | 1 667 | | 1 865 | | 2 306 | | | |
| VNI par action | \$ | 10,20 | \$ | 9,50 | \$ | 11,08 | | | |
| Distribution II | \$ | 34 630 | \$ | 35 654 | \$ | 107 627 | | | |
| Actions émises en circulation | | 4 268 | | 4 652 | | 11 857 | | | |
| VNI par action | \$ | 8,11 | \$ | 7,66 | \$ | 9,08 | | | |
| Catégorie R : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 2 439 | \$ | 2 617 | \$ | 73 221 | | | |
| Actions émises en circulation | | 152 | | 184 | | 4 598 | | | |
| VNI par action | \$ | 16,06 | \$ | 14,25 | \$ | 15,92 | | | |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|------------------------|------------|------------------------|------------|------------------------|------------|
| Fonds Global High Yield Bond Fund (suite) | | | | | | |
| Catégorie T : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 5 769 | \$ | 5 339 | \$ | 7 458 |
| Actions émises en circulation | | 433 | | 448 | | 554 |
| VNI par action | \$ | 13,31 | \$ | 11,93 | \$ | 13,47 |
| Distribution | \$ | 2 662 | \$ | 1 796 | \$ | 2 373 |
| Actions émises en circulation | | 277 | | 200 | | 227 |
| VNI par action | \$ | 9,62 | \$ | 8,96 | \$ | 10,46 |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | € | 1 450 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 130 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 11,14 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | | | | | | |
| Actifs nets | \$ | 10 713 722 | \$ | 10 538 341 | \$ | 17 154 925 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 3 012 636 | \$ | 2 618 560 | \$ | 3 806 107 |
| Actions émises en circulation | | 148 124 | | 140 682 | | 172 781 |
| VNI par action | \$ | 20,34 | \$ | 18,61 | \$ | 22,03 |
| Distribution | \$ | 587 774 | \$ | 474 941 | \$ | 705 907 |
| Actions émises en circulation | | 51 901 | | 44 276 | | 53 902 |
| VNI par action | \$ | 11,32 | \$ | 10,73 | \$ | 13,10 |
| Institutions (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 117 937 | \$ | 100 855 | \$ | 86 823 |
| Actions émises en circulation | | 7 912 | | 7 439 | | 5 244 |
| VNI par action | \$ | 14,91 | \$ | 13,56 | \$ | 16,56 |
| Distribution | \$ | 19 023 | \$ | 22 435 | \$ | 33 395 |
| Actions émises en circulation | | 2 261 | | 2 833 | | 3 347 |
| VNI par action | \$ | 8,41 | \$ | 7,92 | \$ | 9,98 |
| Institutions en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 6 260 | AUD | 7 370 | AUD | 90 155 |
| Actions émises en circulation | | 705 | | 861 | | 8 528 |
| VNI par action | AUD | 8,87 | AUD | 8,56 | AUD | 10,57 |
| Institutions en CAD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | CAD | 12 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | CAD | 9,70 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 529 814 | CHF | 656 465 | CHF | 814 188 |
| Actions émises en circulation | | 34 237 | | 44 353 | | 45 260 |
| VNI par action | CHF | 15,47 | CHF | 14,80 | CHF | 17,99 |
| Distribution | CHF | 31 431 | CHF | 33 474 | CHF | 49 517 |
| Actions émises en circulation | | 4 344 | | 4 674 | | 5 516 |
| VNI par action | CHF | 7,24 | CHF | 7,16 | CHF | 8,98 |
| Institutions en CZK (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | CZK | 195 936 | CZK | 339 010 | CZK | 2 085 033 |
| Actions émises en circulation | | 22 425 | | 41 499 | | 216 797 |
| VNI par action | CZK | 8,74 | CZK | 8,17 | CZK | 9,62 |
| Institutions en EUR (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 47 238 | € | 43 714 | € | 39 844 |
| Actions émises en circulation | | 3 501 | | 3 441 | | 2 737 |
| VNI par action | € | 13,49 | € | 12,70 | € | 14,56 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--|------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | | | | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 1 004 207 | € | 1 343 974 | € | 2 237 224 |
| Actions émises en circulation | | 55 930 | | 79 965 | | 109 970 |
| VNI par action | € | 17,95 | € | 16,81 | € | 20,34 |
| Distribution | € | 365 512 | € | 447 965 | € | 803 485 |
| Actions émises en circulation | | 37 572 | | 47 525 | | 68 258 |
| VNI par action | € | 9,73 | € | 9,43 | € | 11,77 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 125 032 | £ | 112 550 | £ | 258 867 |
| Actions émises en circulation | | 6 164 | | 6 014 | | 11 576 |
| VNI par action | £ | 20,29 | £ | 18,72 | £ | 22,36 |
| Distribution | £ | 637 646 | £ | 767 395 | £ | 1 684 722 |
| Actions émises en circulation | | 55 185 | | 69 403 | | 123 537 |
| VNI par action | £ | 11,55 | £ | 11,06 | £ | 13,64 |
| Institutions en HUF (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | HUF | 9 873 261 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 025 701 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | HUF | 9,63 |
| Institutions en ILS (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | ILS | 9 004 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 531 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | ILS | 16,96 |
| Institutions en NOK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | NOK | 287 785 | NOK | 258 128 | NOK | 429 061 |
| Actions émises en circulation | | 2 009 | | 1 931 | | 2 683 |
| VNI par action | NOK | 143,24 | NOK | 133,69 | NOK | 159,90 |
| Institutions en PLN (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | PLN | 120 869 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 11 435 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | PLN | 10,57 |
| Institutions en SEK (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 2 820 196 | SEK | 2 527 557 | SEK | 3 657 935 |
| Actions émises en circulation | | 183 913 | | 176 118 | | 211 649 |
| VNI par action | SEK | 15,33 | SEK | 14,35 | SEK | 17,28 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 98 125 | SGD | 11 301 | SGD | 8 028 |
| Actions émises en circulation | | 10 785 | | 1 291 | | 749 |
| VNI par action | SGD | 9,10 | SGD | 8,76 | SGD | 10,72 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 337 303 | \$ | 440 714 | \$ | 988 957 |
| Actions émises en circulation | | 15 273 | | 21 729 | | 41 056 |
| VNI par action | \$ | 22,08 | \$ | 20,28 | \$ | 24,09 |
| Distribution | \$ | 143 565 | \$ | 131 169 | \$ | 92 275 |
| Actions émises en circulation | | 11 912 | | 11 489 | | 6 624 |
| VNI par action | \$ | 12,05 | \$ | 11,42 | \$ | 13,93 |
| Investisseurs en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 8 369 | AUD | 10 542 | AUD | 5 854 |
| Actions émises en circulation | | 961 | | 1 256 | | 565 |
| VNI par action | AUD | 8,70 | AUD | 8,39 | AUD | 10,37 |
| Investisseurs en CAD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | CAD | 1 822 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 175 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | CAD | 10,44 |

| | | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|--|-----|---|------------------------|------------------------|
| | | Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
| Investisseurs en CHF (couverte) : | | | | |
| Capitalisation | CHF | 4 911 | CHF 5 359 | CHF 7 624 |
| Actions émises en circulation | | 435 | 494 | 577 |
| VNI par action | CHF | 11,29 | CHF 10,84 | CHF 13,22 |
| Distribution | CHF | 4 293 | CHF 5 334 | CHF 8 176 |
| Actions émises en circulation | | 461 | 578 | 707 |
| VNI par action | CHF | 9,32 | CHF 9,23 | CHF 11,56 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | |
| Capitalisation | € | 31 093 | € 26 086 | € 49 619 |
| Actions émises en circulation | | 1 843 | 1 646 | 2 577 |
| VNI par action | € | 16,87 | € 15,85 | € 19,25 |
| Distribution | € | 10 366 | € 11 379 | € 16 646 |
| Actions émises en circulation | | 1 016 | 1 151 | 1 349 |
| VNI par action | € | 10,20 | € 9,88 | € 12,34 |
| Investisseurs en GBP (couverte) : | | | | |
| Distribution | £ | 4 257 | £ 4 175 | £ 5 735 |
| Actions émises en circulation | | 379 | 389 | 433 |
| VNI par action | £ | 11,24 | £ 10,73 | £ 13,23 |
| Investisseurs en RMB (couverte) : | | | | |
| Distribution | | S/O | S/O | CNH 3 345 |
| Actions émises en circulation | | S/O | S/O | 30 |
| VNI par action | | S/O | S/O | CNH 111,93 |
| Investisseurs en SGD (couverte) : | | | | |
| Distribution | SGD | 7 115 | SGD 7 277 | SGD 7 473 |
| Actions émises en circulation | | 802 | 852 | 715 |
| VNI par action | SGD | 8,88 | SGD 8,54 | SGD 10,45 |
| Administrations : | | | | |
| Capitalisation | \$ | 88 580 | \$ 76 931 | \$ 215 743 |
| Actions émises en circulation | | 4 693 | 4 431 | 10 444 |
| VNI par action | \$ | 18,88 | \$ 17,36 | \$ 20,66 |
| Distribution | \$ | 70 601 | \$ 47 290 | \$ 99 369 |
| Actions émises en circulation | | 6 060 | 4 285 | 7 378 |
| VNI par action | \$ | 11,65 | \$ 11,04 | \$ 13,47 |
| Administrations en CHF (couverte) : | | | | |
| Capitalisation | CHF | 173 | CHF 391 | CHF 629 |
| Actions émises en circulation | | 17 | 41 | 54 |
| VNI par action | CHF | 9,92 | CHF 9,54 | CHF 11,65 |
| Administrations en EUR (couverte) : | | | | |
| Capitalisation | € | 10 048 | € 7 522 | € 9 518 |
| Actions émises en circulation | | 632 | 503 | 523 |
| VNI par action | € | 15,91 | € 14,97 | € 18,21 |
| Distribution | € | 9 002 | € 7 846 | € 9 315 |
| Actions émises en circulation | | 914 | 822 | 782 |
| VNI par action | € | 9,85 | € 9,54 | € 11,91 |
| Administrations en GBP (couverte) : | | | | |
| Distribution | £ | 6 900 | £ 4 557 | £ 6 985 |
| Actions émises en circulation | | 617 | 427 | 531 |
| VNI par action | £ | 11,18 | £ 10,68 | £ 13,17 |
| Administrations en HKD (non couverte) : | | | | |
| Distribution | HKD | 35 963 | HKD 10 505 | HKD 12 810 |
| Actions émises en circulation | | 4 033 | 1 244 | 1 244 |
| VNI par action | HKD | 8,92 | HKD 8,44 | HKD 10,30 |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | | |
| Capitalisation | SEK | 61 831 | SEK 901 901 | SEK 936 226 |
| Actions émises en circulation | | 5 733 | 88 869 | 76 221 |
| VNI par action | SEK | 10,78 | SEK 10,15 | SEK 12,28 |
| Administrations en SGD (couverte) : | | | | |
| Distribution | SGD | 19 497 | SGD 2 918 | SGD 5 459 |
| Actions émises en circulation | | 2 276 | 354 | 542 |
| VNI par action | SGD | 8,56 | SGD 8,24 | SGD 10,08 |

| | | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|--|-----|---|------------------------|------------------------|
| | | Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
| BM Détail : | | | | |
| Décumulation | \$ | 10 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | \$ | 9,95 | S/O | S/O |
| Catégorie E : | | | | |
| Capitalisation | \$ | 726 293 | \$ 605 749 | \$ 799 659 |
| Actions émises en circulation | | 40 860 | 36 905 | 40 796 |
| VNI par action | \$ | 17,78 | \$ 16,41 | \$ 19,60 |
| Distribution | \$ | 249 811 | \$ 216 440 | \$ 341 550 |
| Actions émises en circulation | | 20 324 | 18 589 | 24 037 |
| VNI par action | \$ | 12,29 | \$ 11,64 | \$ 14,21 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | |
| Capitalisation | CHF | 48 855 | CHF 52 629 | CHF 78 253 |
| Actions émises en circulation | | 4 786 | 5 342 | 6 476 |
| VNI par action | CHF | 10,21 | CHF 9,85 | CHF 12,08 |
| Catégorie E en EUR (exposition au risque de change) : | | | | |
| Distribution | € | 1 375 | € 1 340 | € 3 077 |
| Actions émises en circulation | | 148 | 148 | 288 |
| VNI par action | € | 9,26 | € 9,03 | € 10,67 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | |
| Capitalisation | € | 350 203 | € 451 796 | € 630 730 |
| Actions émises en circulation | | 22 889 | 31 264 | 35 735 |
| VNI par action | € | 15,30 | € 14,45 | € 17,65 |
| Distribution | € | 191 362 | € 197 011 | € 271 438 |
| Actions émises en circulation | | 22 805 | 24 230 | 26 741 |
| VNI par action | € | 8,39 | € 8,13 | € 10,15 |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | | | |
| Distribution | £ | 20 954 | £ 20 979 | £ 31 335 |
| Actions émises en circulation | | 1 795 | 1 881 | 2 279 |
| VNI par action | £ | 11,68 | £ 11,15 | £ 13,75 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | |
| Distribution | SGD | 48 801 | SGD 30 453 | SGD 37 343 |
| Actions émises en circulation | | 5 352 | 3 472 | 3 481 |
| VNI par action | SGD | 9,12 | SGD 8,77 | SGD 10,73 |
| H Institutions : | | | | |
| Capitalisation | \$ | 485 344 | \$ 282 176 | \$ 168 210 |
| Actions émises en circulation | | 22 978 | 14 572 | 7 327 |
| VNI par action | \$ | 21,12 | \$ 19,36 | \$ 22,96 |
| Distribution | \$ | 18 189 | \$ 17 320 | \$ 14 287 |
| Actions émises en circulation | | 1 990 | 2 000 | 1 351 |
| VNI par action | \$ | 9,14 | \$ 8,66 | \$ 10,57 |
| H Institutions (exposition au risque de change) : | | | | |
| Capitalisation | \$ | 85 535 | \$ 184 082 | \$ 10 |
| Actions émises en circulation | | 9 678 | 22 850 | 1 |
| VNI par action | \$ | 8,84 | \$ 8,06 | \$ 9,85 |
| M Détail : | | | | |
| Décumulation | \$ | 10 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | \$ | 9,96 | S/O | S/O |
| Distribution | \$ | 28 765 | \$ 25 037 | \$ 49 229 |
| Actions émises en circulation | | 3 092 | 2 840 | 4 577 |
| VNI par action | \$ | 9,30 | \$ 8,82 | \$ 10,76 |
| Distribution II | \$ | 89 186 | \$ 86 672 | \$ 120 251 |
| Actions émises en circulation | | 10 736 | 10 861 | 12 179 |
| VNI par action | \$ | 8,31 | \$ 7,98 | \$ 9,87 |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | | | |
| Distribution | HKD | 9 098 | HKD 8 376 | HKD 9 145 |
| Actions émises en circulation | | 1 019 | 990 | 887 |
| VNI par action | HKD | 8,93 | HKD 8,46 | HKD 10,31 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | |
|--|---|------------------------|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
| Catégorie R : | | | |
| Capitalisation | \$ 11 284 | \$ 16 316 | \$ 28 433 |
| Actions émises en circulation | 876 | 1 381 | 2 028 |
| VNI par action | \$ 12,88 | \$ 11,81 | \$ 14,02 |
| Distribution | \$ 4 627 | \$ 4 870 | \$ 6 925 |
| Actions émises en circulation | 502 | 558 | 650 |
| VNI par action | \$ 9,22 | \$ 8,73 | \$ 10,66 |
| Catégorie R en EUR (couverte) : | | | |
| Distribution | € 2 174 | € 2 758 | € 6 026 |
| Actions émises en circulation | 278 | 364 | 636 |
| VNI par action | € 7,83 | € 7,59 | € 9,47 |
| Catégorie R en GBP (couverte) : | | | |
| Distribution | £ 6 122 | £ 8 117 | £ 11 449 |
| Actions émises en circulation | 718 | 998 | 1 141 |
| VNI par action | £ 8,52 | £ 8,14 | £ 10,04 |
| Catégorie T : | | | |
| Capitalisation | \$ 26 285 | \$ 28 595 | \$ 42 303 |
| Actions émises en circulation | 2 375 | 2 786 | 3 438 |
| VNI par action | \$ 11,07 | \$ 10,26 | \$ 12,30 |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 4 398 | € 3 508 | € 4 875 |
| Actions émises en circulation | 467 | 393 | 446 |
| VNI par action | € 9,41 | € 8,92 | € 10,94 |
| Catégorie W : | | | |
| Capitalisation | \$ 43 413 | \$ 32 822 | \$ 66 615 |
| Actions émises en circulation | 4 609 | 3 811 | 6 543 |
| VNI par action | \$ 9,42 | \$ 8,61 | \$ 10,18 |
| Distribution | \$ 20 522 | \$ 11 533 | \$ 20 732 |
| Actions émises en circulation | 2 421 | 1 437 | 2 116 |
| VNI par action | \$ 8,48 | \$ 8,03 | \$ 9,80 |
| Catégorie W en CHF (couverte) : | | | |
| Capitalisation | CHF 20 410 | CHF 20 144 | CHF 32 864 |
| Actions émises en circulation | 2 362 | 2 440 | 3 278 |
| VNI par action | CHF 8,64 | CHF 8,26 | CHF 10,03 |
| Catégorie W en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 15 763 | € 14 812 | € 150 079 |
| Actions émises en circulation | 1 773 | 1 781 | 14 925 |
| VNI par action | € 8,89 | € 8,31 | € 10,06 |
| Distribution | € 5 515 | € 2 194 | € 3 545 |
| Actions émises en circulation | 690 | 283 | 367 |
| VNI par action | € 7,99 | € 7,74 | € 9,67 |
| Catégorie W en GBP (couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 3 652 | £ 3 270 | £ 515 |
| Actions émises en circulation | 396 | 385 | 51 |
| VNI par action | £ 9,22 | £ 8,50 | £ 10,15 |
| Distribution | £ 13 232 | £ 6 970 | £ 16 284 |
| Actions émises en circulation | 1 596 | 881 | 1 668 |
| VNI par action | £ 8,29 | £ 7,92 | £ 9,76 |
| Catégorie W en SGD (couverte) : | | | |
| Distribution | SGD 14 814 | SGD 4 506 | SGD 810 |
| Actions émises en circulation | 1 780 | 563 | 83 |
| VNI par action | SGD 8,32 | SGD 8,01 | SGD 9,79 |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 2 170 207 | \$ 1 369 890 | \$ 1 189 563 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 64 347 | \$ 61 632 | \$ 39 212 |
| Actions émises en circulation | 5 695 | 5 924 | 3 211 |
| VNI par action | \$ 11,30 | \$ 10,40 | \$ 12,21 |
| Distribution | \$ 121 717 | \$ 10 347 | \$ 19 429 |
| Actions émises en circulation | 13 032 | 1 167 | 1 825 |
| VNI par action | \$ 9,34 | \$ 8,86 | \$ 10,65 |

| | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite) | | |
|--|---|------------------------|------------------------|
| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | |
| Capitalisation | CHF 190 076 | CHF 190 278 | CHF 185 627 |
| Actions émises en circulation | 19 472 | 20 258 | 16 381 |
| VNI par action | CHF 9,76 | CHF 9,39 | CHF 11,33 |
| Distribution | CHF 3 016 | CHF 2 020 | CHF 3 002 |
| Actions émises en circulation | 374 | 253 | 304 |
| VNI par action | CHF 8,07 | CHF 8,00 | CHF 9,88 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 538 219 | € 220 186 | € 229 148 |
| Actions émises en circulation | 53 109 | 23 072 | 19 996 |
| VNI par action | € 10,13 | € 9,54 | € 11,46 |
| Distribution | € 243 292 | € 320 757 | € 42 749 |
| Actions émises en circulation | 29 217 | 39 702 | 4 306 |
| VNI par action | € 8,33 | € 8,08 | € 9,93 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 31 445 | £ 72 284 | £ 83 370 |
| Actions émises en circulation | 2 940 | 7 283 | 7 085 |
| VNI par action | £ 10,70 | £ 9,92 | £ 11,77 |
| Distribution | £ 270 851 | £ 87 512 | £ 155 708 |
| Actions émises en circulation | 29 628 | 9 955 | 14 592 |
| VNI par action | £ 9,14 | £ 8,79 | £ 10,67 |
| Institutions en SEK (couverte) : | | | |
| Capitalisation | SEK 32 957 | SEK 11 028 | S/O |
| Actions émises en circulation | 299 | 106 | S/O |
| VNI par action | SEK 110,07 | SEK 103,64 | S/O |
| Investisseurs : | | | |
| Capitalisation | \$ 130 | \$ 217 | \$ 141 |
| Actions émises en circulation | 14 | 25 | 14 |
| VNI par action | \$ 9,27 | \$ 8,56 | \$ 10,09 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 10 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | € 10,50 | S/O | S/O |
| Distribution | € 10 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | € 10,23 | S/O | S/O |
| Administrations en SEK (couverte) : | | | |
| Capitalisation | SEK 4 672 844 | SEK 3 047 191 | SEK 2 293 688 |
| Actions émises en circulation | 50 829 | 35 030 | 21 953 |
| VNI par action | SEK 91,93 | SEK 86,99 | SEK 104,48 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 10 138 | \$ 1 735 | \$ 3 820 |
| Actions émises en circulation | 1 086 | 200 | 372 |
| VNI par action | \$ 9,34 | \$ 8,68 | \$ 10,28 |
| Distribution | \$ 3 728 | \$ 446 | \$ 834 |
| Actions émises en circulation | 419 | 53 | 82 |
| VNI par action | \$ 8,90 | \$ 8,45 | \$ 10,15 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | |
| Capitalisation | CHF 402 | CHF 491 | CHF 194 |
| Actions émises en circulation | 48 | 60 | 19 |
| VNI par action | CHF 8,46 | CHF 8,22 | CHF 10,01 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|----------------------------------|---|---------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite) | | | | | |
| Distribution | CHF | 24 | CHF | 24 | CHF | 30 |
| Actions émises en circulation | | 3 | | 3 | | 3 |
| VNI par action | CHF | 8,07 | CHF | 8,00 | CHF | 9,87 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 16 648 | € | 3 370 | € | 7 130 |
| Actions émises en circulation | | 1 906 | | 406 | | 709 |
| VNI par action | € | 8,73 | € | 8,29 | € | 10,05 |
| Distribution | € | 638 | € | 581 | € | 869 |
| Actions émises en circulation | | 77 | | 72 | | 88 |
| VNI par action | € | 8,32 | € | 8,07 | € | 9,92 |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 690 | £ | 420 | £ | 503 |
| Actions émises en circulation | | 76 | | 50 | | 50 |
| VNI par action | £ | 9,06 | £ | 8,49 | £ | 10,16 |
| Distribution | | S/O | | S/O | £ | 104 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 10 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | £ | 10,02 |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 4 612 | \$ | 19 339 | \$ | 22 582 |
| Actions émises en circulation | | 434 | | 1 986 | | 1 986 |
| VNI par action | \$ | 10,63 | \$ | 9,74 | \$ | 11,37 |
| Actifs nets | | | | | | |
| | | | | | | |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 59 349 | \$ | 136 292 | \$ | 150 363 |
| Actions émises en circulation | | 4 779 | | 11 554 | | 12 580 |
| VNI par action | \$ | 12,42 | \$ | 11,80 | \$ | 11,95 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 37 402 | CHF | 22 752 | CHF | 32 711 |
| Actions émises en circulation | | 3 747 | | 2 303 | | 3 190 |
| VNI par action | CHF | 9,98 | CHF | 9,88 | CHF | 10,25 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 267 868 | € | 498 384 | € | 518 804 |
| Actions émises en circulation | | 25 334 | | 48 614 | | 48 941 |
| VNI par action | € | 10,57 | € | 10,25 | € | 10,60 |
| Distribution | € | 24 318 | € | 34 131 | € | 45 289 |
| Actions émises en circulation | | 2 748 | | 3 856 | | 4 630 |
| VNI par action | € | 8,85 | € | 8,85 | € | 9,78 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 34 278 | £ | 55 816 | £ | 63 979 |
| Actions émises en circulation | | 3 010 | | 5 128 | | 5 771 |
| VNI par action | £ | 11,39 | £ | 10,88 | £ | 11,09 |
| Distribution | £ | 67 020 | £ | 62 640 | £ | 57 902 |
| Actions émises en circulation | | 7 240 | | 6 761 | | 5 720 |
| VNI par action | £ | 9,26 | £ | 9,26 | £ | 10,12 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 609 791 | SGD | 351 313 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 58 427 | | 34 943 | | S/O |
| VNI par action | SGD | 10,44 | SGD | 10,05 | | S/O |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 4 357 | \$ | 6 751 | \$ | 5 146 |
| Actions émises en circulation | | 364 | | 591 | | 443 |
| VNI par action | \$ | 11,98 | \$ | 11,42 | \$ | 11,61 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 24 371 | \$ | 34 924 | \$ | 26 574 |
| Actions émises en circulation | | 2 145 | | 3 206 | | 2 386 |
| VNI par action | \$ | 11,36 | \$ | 10,89 | \$ | 11,14 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 118 010 | € | 177 147 | € | 153 469 |
| Actions émises en circulation | | 12 201 | | 18 721 | | 15 545 |
| VNI par action | € | 9,67 | € | 9,46 | € | 9,87 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|---|-------------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Global Real Return Fund | | | | | |
| Actifs nets | \$ | 2 381 093 | \$ | 2 571 862 | \$ | 3 703 379 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 286 542 | \$ | 272 591 | \$ | 380 827 |
| Actions émises en circulation | | 12 657 | | 12 628 | | 14 784 |
| VNI par action | \$ | 22,64 | \$ | 21,59 | \$ | 25,76 |
| Distribution | \$ | 5 867 | \$ | 12 328 | \$ | 22 531 |
| Actions émises en circulation | | 373 | | 796 | | 1 136 |
| VNI par action | \$ | 15,71 | \$ | 15,49 | \$ | 19,84 |
| Institutions (exposition au risque de change) : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 49 161 | \$ | 47 075 | \$ | 68 405 |
| Actions émises en circulation | | 4 759 | | 4 828 | | 5 543 |
| VNI par action | \$ | 10,33 | \$ | 9,75 | \$ | 12,34 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 52 476 | CHF | 56 131 | CHF | 63 005 |
| Actions émises en circulation | | 3 973 | | 4 267 | | 3 907 |
| VNI par action | CHF | 13,21 | CHF | 13,15 | CHF | 16,12 |
| Distribution | CHF | 27 158 | CHF | 33 615 | CHF | 38 988 |
| Actions émises en circulation | | 3 248 | | 3 898 | | 3 438 |
| VNI par action | CHF | 8,36 | CHF | 8,62 | CHF | 11,34 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 664 628 | € | 824 251 | € | 1 075 404 |
| Actions émises en circulation | | 35 832 | | 45 572 | | 48 681 |
| VNI par action | € | 18,55 | € | 18,09 | € | 22,09 |
| Distribution | € | 84 433 | € | 98 750 | € | 140 728 |
| Actions émises en circulation | | 6 690 | | 7 750 | | 8 415 |
| VNI par action | € | 12,62 | € | 12,74 | € | 16,72 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 34 169 | £ | 38 820 | £ | 45 209 |
| Actions émises en circulation | | 2 789 | | 3 298 | | 3 177 |
| VNI par action | £ | 12,25 | £ | 11,77 | £ | 14,23 |
| Distribution | £ | 185 264 | £ | 205 454 | £ | 276 097 |
| Actions émises en circulation | | 23 332 | | 25 531 | | 26 297 |
| VNI par action | £ | 7,94 | £ | 8,05 | £ | 10,50 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 243 298 | SGD | 236 796 | SGD | 307 106 |
| Actions émises en circulation | | 14 905 | | 14 984 | | 16 250 |
| VNI par action | SGD | 16,32 | SGD | 15,80 | SGD | 18,90 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 33 204 | \$ | 63 935 | \$ | 92 993 |
| Actions émises en circulation | | 1 575 | | 3 170 | | 3 850 |
| VNI par action | \$ | 21,08 | \$ | 20,17 | \$ | 24,16 |
| Distribution | \$ | 12 287 | \$ | 9 038 | \$ | 31 044 |
| Actions émises en circulation | | 898 | | 669 | | 1 795 |
| VNI par action | \$ | 13,68 | \$ | 13,51 | \$ | 17,30 |
| Investisseurs en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | CHF | 1 598 | CHF | 2 516 | CHF | 5 139 |
| Actions émises en circulation | | 152 | | 232 | | 360 |
| VNI par action | CHF | 10,53 | CHF | 10,85 | CHF | 14,28 |

| | Au | | | Au | | | Au | | |
|--|------------------|-----------|-----|------------------|-----|-----------|------------------|--|--|
| | 31 décembre 2023 | | | 31 décembre 2022 | | | 31 décembre 2021 | | |
| Fonds Income Fund (suite) | | | | | | | | | |
| Institutions en NOK | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | NOK | 2 372 450 | NOK | 2 153 310 | NOK | 2 187 743 | | | |
| Actions émises en circulation | | 20 619 | | 19 915 | | 18 488 | | | |
| VNI par action | NOK | 115,06 | NOK | 108,13 | NOK | 118,34 | | | |
| Institutions en RMB | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | CNH | 66 | | | |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 | | | |
| VNI par action | | S/O | | S/O | CNH | 101,42 | | | |
| Distribution | RMB | 75 | | S/O | | S/O | | | |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O | | | |
| VNI par action | RMB | 101,93 | | S/O | | S/O | | | |
| Institutions en SGD | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 99 211 | SGD | 57 007 | SGD | 46 472 | | | |
| Actions émises en circulation | | 9 134 | | 5 614 | | 4 222 | | | |
| VNI par action | SGD | 10,86 | SGD | 10,15 | SGD | 11,01 | | | |
| Distribution | SGD | 411 788 | SGD | 233 054 | SGD | 277 493 | | | |
| Actions émises en circulation | | 43 143 | | 24 522 | | 25 607 | | | |
| VNI par action | SGD | 9,54 | SGD | 9,50 | SGD | 10,84 | | | |
| Investisseurs en USD | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 2 002 496 | \$ | 1 938 128 | \$ | 2 841 494 | | | |
| Actions émises en circulation | | 144 086 | | 150 961 | | 203 964 | | | |
| VNI par action | \$ | 13,90 | \$ | 12,84 | \$ | 13,93 | | | |
| Distribution | \$ | 1 450 049 | \$ | 1 424 611 | \$ | 1 709 869 | | | |
| Actions émises en circulation | | 153 164 | | 152 992 | | 160 791 | | | |
| VNI par action | \$ | 9,47 | \$ | 9,31 | \$ | 10,63 | | | |
| Investisseurs en AUD | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | AUD | 84 018 | AUD | 64 155 | AUD | 73 714 | | | |
| Actions émises en circulation | | 9 724 | | 7 404 | | 7 348 | | | |
| VNI par action | AUD | 8,64 | AUD | 8,66 | AUD | 10,03 | | | |
| Investisseurs en EUR | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 226 229 | € | 212 831 | € | 508 040 | | | |
| Actions émises en circulation | | 19 795 | | 19 702 | | 42 352 | | | |
| VNI par action | € | 11,43 | € | 10,80 | € | 12,00 | | | |
| Distribution | € | 86 099 | € | 75 705 | € | 105 743 | | | |
| Actions émises en circulation | | 11 198 | | 9 766 | | 11 634 | | | |
| VNI par action | € | 7,69 | € | 7,75 | € | 9,09 | | | |
| Distribution A | € | 24 484 | € | 29 277 | € | 37 920 | | | |
| Actions émises en circulation | | 3 069 | | 3 673 | | 4 052 | | | |
| VNI par action | € | 7,98 | € | 7,97 | € | 9,36 | | | |
| Investisseurs en GBP | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | £ | 18 236 | £ | 16 799 | £ | 9 219 | | | |
| Actions émises en circulation | | 2 117 | | 1 965 | | 935 | | | |
| VNI par action | £ | 8,62 | £ | 8,55 | £ | 9,86 | | | |
| Investisseurs en HKD (non couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | HKD | 84 | | S/O | | S/O | | | |
| Actions émises en circulation | | 8 | | S/O | | S/O | | | |
| VNI par action | HKD | 10,61 | | S/O | | S/O | | | |
| Investisseurs en JPY | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | ¥ | 1 376 | | S/O | | S/O | | | |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O | | | |
| VNI par action | ¥ | 1 021,00 | | S/O | | S/O | | | |
| Investisseurs en RMB | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | CNH | 105 901 | CNH | 66 886 | CNH | 124 077 | | | |
| Actions émises en circulation | | 871 | | 579 | | 994 | | | |
| VNI par action | CNH | 121,55 | CNH | 115,46 | CNH | 124,87 | | | |
| Investisseurs en SGD | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 17 361 | SGD | 6 150 | SGD | 1 979 | | | |
| Actions émises en circulation | | 1 656 | | 625 | | 185 | | | |
| VNI par action | SGD | 10,48 | SGD | 9,84 | SGD | 10,70 | | | |
| Distribution | SGD | 69 437 | SGD | 47 450 | SGD | 67 208 | | | |
| Actions émises en circulation | | 7 811 | | 5 340 | | 6 605 | | | |
| VNI par action | SGD | 8,89 | SGD | 8,89 | SGD | 10,18 | | | |
| Administrations : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 912 884 | \$ | 744 526 | \$ | 912 059 | | | |
| Actions émises en circulation | | 74 250 | | 65 457 | | 73 786 | | | |
| VNI par action | \$ | 12,29 | \$ | 11,37 | \$ | 12,36 | | | |
| Distribution | \$ | 3 565 795 | \$ | 2 930 269 | \$ | 3 699 459 | | | |
| Actions émises en circulation | | 353 150 | | 294 606 | | 325 103 | | | |
| VNI par action | \$ | 10,10 | \$ | 9,95 | \$ | 11,38 | | | |
| Administrations en AUD | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | AUD | 406 120 | AUD | 286 887 | AUD | 316 049 | | | |
| Actions émises en circulation | | 45 885 | | 32 273 | | 30 677 | | | |
| VNI par action | AUD | 8,85 | AUD | 8,89 | AUD | 10,30 | | | |
| Administrations en EUR | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 85 658 | € | 96 175 | € | 193 792 | | | |
| Actions émises en circulation | | 7 555 | | 8 961 | | 16 228 | | | |
| VNI par action | € | 11,34 | € | 10,73 | € | 11,94 | | | |
| Distribution | € | 305 892 | € | 266 419 | € | 308 049 | | | |
| Actions émises en circulation | | 39 257 | | 33 865 | | 33 362 | | | |
| VNI par action | € | 7,79 | € | 7,87 | € | 9,23 | | | |
| Administrations en GBP | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | £ | 142 362 | £ | 112 506 | £ | 140 149 | | | |
| Actions émises en circulation | | 17 119 | | 13 611 | | 14 660 | | | |
| VNI par action | £ | 8,32 | £ | 8,27 | £ | 9,56 | | | |
| Administrations en HKD | | | | | | | | | |
| (non couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | HKD | 4 564 281 | HKD | 3 221 408 | HKD | 4 681 912 | | | |
| Actions émises en circulation | | 508 704 | | 364 591 | | 463 488 | | | |
| VNI par action | HKD | 8,97 | HKD | 8,84 | HKD | 10,10 | | | |
| Administrations en JPY | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | ¥ | 1 099 | | | |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 1 | | | |
| VNI par action | | S/O | | S/O | ¥ | 999,00 | | | |
| Administrations en SGD | | | | | | | | | |
| (couverte) : | | | | | | | | | |
| Distribution | SGD | 1 829 067 | SGD | 971 804 | SGD | 1 080 475 | | | |
| Actions émises en circulation | | 186 853 | | 99 186 | | 96 129 | | | |
| VNI par action | SGD | 9,79 | SGD | 9,80 | SGD | 11,24 | | | |
| Catégorie E : | | | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 5 787 064 | \$ | 4 837 460 | \$ | 6 088 898 | | | |
| Actions émises en circulation | | 372 334 | | 335 073 | | 386 539 | | | |
| VNI par action | \$ | 15,54 | \$ | 14,44 | \$ | 15,75 | | | |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|-------------------------------------|---------------------------|------------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Income Fund (suite) | | | | | |
| Distribution | \$ | 8 737 093 | \$ | 6 857 888 | \$ | 8 765 914 |
| Actions émises en circulation | | 911 535 | | 723 233 | | 804 221 |
| VNI par action | \$ | 9,59 | \$ | 9,48 | \$ | 10,90 |
| Distribution Q | | S/O | | S/O | \$ | 2 029 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 203 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 10,01 |
| Catégorie E en AUD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | AUD | 799 635 | AUD | 595 621 | AUD | 699 187 |
| Actions émises en circulation | | 96 656 | | 71 382 | | 71 928 |
| VNI par action | AUD | 8,27 | AUD | 8,34 | AUD | 9,72 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 68 634 | CHF | 80 590 | CHF | 101 113 |
| Actions émises en circulation | | 6 257 | | 7 568 | | 8 472 |
| VNI par action | CHF | 10,97 | CHF | 10,65 | CHF | 11,93 |
| Distribution | CHF | 237 431 | CHF | 80 502 | CHF | 117 164 |
| Actions émises en circulation | | 34 173 | | 11 178 | | 13 731 |
| VNI par action | CHF | 6,95 | CHF | 7,20 | CHF | 8,53 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 4 941 016 | € | 4 356 288 | € | 5 062 678 |
| Actions émises en circulation | | 377 958 | | 350 614 | | 364 865 |
| VNI par action | € | 13,07 | € | 12,42 | € | 13,88 |
| Distribution | € | 3 451 544 | € | 3 436 223 | € | 4 359 865 |
| Actions émises en circulation | | 438 473 | | 430 505 | | 462 802 |
| VNI par action | € | 7,87 | € | 7,98 | € | 9,42 |
| Distribution II | € | 158 809 | € | 121 587 | € | 125 779 |
| Actions émises en circulation | | 17 751 | | 13 705 | | 12 308 |
| VNI par action | € | 8,95 | € | 8,87 | € | 10,22 |
| Distribution II Q | € | 32 842 | € | 38 028 | € | 52 706 |
| Actions émises en circulation | | 3 722 | | 4 345 | | 5 208 |
| VNI par action | € | 8,82 | € | 8,75 | € | 10,12 |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ | 232 770 | £ | 208 926 | £ | 236 936 |
| Actions émises en circulation | | 29 126 | | 26 188 | | 25 560 |
| VNI par action | £ | 7,99 | £ | 7,98 | £ | 9,27 |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution | HKD | 4 105 214 | HKD | 3 442 414 | HKD | 4 704 540 |
| Actions émises en circulation | | 454 999 | | 385 795 | | 459 225 |
| VNI par action | HKD | 9,02 | HKD | 8,92 | HKD | 10,24 |
| Catégorie E en JPY (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | ¥ | 11 142 148 | ¥ | 4 076 871 | ¥ | 743 601 |
| Actions émises en circulation | | 11 433 | | 4 248 | | 692 |
| VNI par action | ¥ | 975,00 | ¥ | 960,00 | ¥ | 1 075,00 |
| Distribution | ¥ | 52 326 950 | ¥ | 1 381 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 55 343 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | ¥ | 946,00 | ¥ | 992,00 | | S/O |
| Catégorie E en RMB (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | CNH | 988 205 | CNH | 490 076 | CNH | 671 398 |
| Actions émises en circulation | | 9 238 | | 4 497 | | 5 397 |
| VNI par action | CNH | 106,97 | CNH | 108,97 | CNH | 124,39 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|------------------------------------|---------------------------|-----------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Income Fund (suite) | | | | | |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 4 758 628 | SGD | 2 537 340 | SGD | 2 784 269 |
| Actions émises en circulation | | 551 466 | | 292 512 | | 278 445 |
| VNI par action | SGD | 8,63 | SGD | 8,67 | SGD | 10,00 |
| G Détail en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | € | 81 915 | € | 18 496 | € | 29 724 |
| Actions émises en circulation | | 10 629 | | 2 393 | | 3 263 |
| VNI par action | € | 7,71 | € | 7,73 | € | 9,11 |
| G Détail en EUR (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | € | 518 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 51 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 10,11 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 918 636 | \$ | 669 952 | \$ | 770 236 |
| Actions émises en circulation | | 76 610 | | 60 591 | | 64 313 |
| VNI par action | \$ | 11,99 | \$ | 11,06 | \$ | 11,98 |
| Distribution | \$ | 452 440 | \$ | 287 285 | \$ | 333 808 |
| Actions émises en circulation | | 48 671 | | 31 482 | | 32 084 |
| VNI par action | \$ | 9,30 | \$ | 9,13 | \$ | 10,40 |
| H Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | € | 8 530 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 772 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 11,05 |
| Catégorie R : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 95 966 | \$ | 82 073 | \$ | 70 929 |
| Actions émises en circulation | | 8 690 | | 8 054 | | 6 420 |
| VNI par action | \$ | 11,04 | \$ | 10,19 | \$ | 11,05 |
| Distribution | \$ | 62 563 | \$ | 61 635 | \$ | 84 900 |
| Actions émises en circulation | | 6 676 | | 6 695 | | 8 082 |
| VNI par action | \$ | 9,37 | \$ | 9,21 | \$ | 10,50 |
| Catégorie R en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | € | 12 323 | € | 12 865 | € | 16 112 |
| Actions émises en circulation | | 1 511 | | 1 567 | | 1 678 |
| VNI par action | € | 8,15 | € | 8,21 | € | 9,60 |
| Catégorie R en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ | 25 773 | £ | 20 954 | £ | 33 995 |
| Actions émises en circulation | | 2 706 | | 2 220 | | 3 123 |
| VNI par action | £ | 9,52 | £ | 9,44 | £ | 10,88 |
| Catégorie T : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 314 165 | \$ | 295 923 | \$ | 371 744 |
| Actions émises en circulation | | 24 722 | | 24 971 | | 28 634 |
| VNI par action | \$ | 12,71 | \$ | 11,85 | \$ | 12,98 |
| Distribution | \$ | 115 745 | \$ | 102 600 | \$ | 130 671 |
| Actions émises en circulation | | 13 763 | | 12 279 | | 13 542 |
| VNI par action | \$ | 8,41 | \$ | 8,36 | \$ | 9,65 |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 252 546 | € | 226 266 | € | 268 086 |
| Actions émises en circulation | | 23 488 | | 22 053 | | 23 304 |
| VNI par action | € | 10,75 | € | 10,26 | € | 11,50 |
| Distribution | € | 172 434 | € | 165 117 | € | 217 088 |
| Actions émises en circulation | | 24 832 | | 23 351 | | 25 890 |
| VNI par action | € | 6,94 | € | 7,07 | € | 8,38 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|-------------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Income Fund (suite) | | | |
| Catégorie Z : | | | |
| Capitalisation | \$ 191 273 | \$ 219 519 | \$ 162 794 |
| Actions émises en circulation | 10 499 | 13 161 | 9 076 |
| VNI par action | \$ 18,22 | \$ 16,68 | \$ 17,94 |
| Catégorie Z en AUD (couverte) : | | | |
| Distribution II | AUD 1 331 421 | AUD 1 339 063 | AUD 1 451 394 |
| Actions émises en circulation | 134 703 | 136 394 | 129 096 |
| VNI par action | AUD 9,88 | AUD 9,82 | AUD 11,24 |
| Fonds Income Fund II | | | |
| Actifs nets | \$ 125 160 | \$ 56 623 | \$ 27 770 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 24 344 | \$ 22 431 | \$ 24 374 |
| Actions émises en circulation | 2 396 | 2 396 | 2 396 |
| VNI par action | \$ 10,16 | \$ 9,35 | \$ 10,17 |
| Distribution | S/O | S/O | \$ 10 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 1 |
| VNI par action | S/O | S/O | \$ 9,94 |
| Distribution | \$ 11 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | S/O | S/O |
| VNI par action | \$ 10,30 | S/O | S/O |
| Catégorie E : | | | |
| Distribution | \$ 45 250 | \$ 17 894 | \$ 1 730 |
| Actions émises en circulation | 5 130 | 2 069 | 174 |
| VNI par action | \$ 8,82 | \$ 8,65 | \$ 9,92 |
| Catégorie E en AUD (couverte) : | | | |
| Distribution | AUD 13 403 | AUD 2 119 | AUD 365 |
| Actions émises en circulation | 1 571 | 249 | 37 |
| VNI par action | AUD 8,53 | AUD 8,52 | AUD 9,90 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | |
| Distribution | € 5 479 | € 3 221 | € 494 |
| Actions émises en circulation | 658 | 385 | 50 |
| VNI par action | € 8,33 | € 8,37 | € 9,85 |
| Catégorie E en GBP (couverte) : | | | |
| Distribution | £ 12 067 | £ 2 810 | £ 196 |
| Actions émises en circulation | 1 396 | 329 | 20 |
| VNI par action | £ 8,64 | £ 8,55 | £ 9,90 |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : | | | |
| Distribution | HKD 192 869 | HKD 62 867 | HKD 2 462 |
| Actions émises en circulation | 21 739 | 7 226 | 247 |
| VNI par action | HKD 8,87 | HKD 8,70 | HKD 9,98 |
| Catégorie E en JPY (couverte) : | | | |
| Distribution | ¥ 38 723 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 38 | S/O | S/O |
| VNI par action | ¥ 1 029,00 | S/O | S/O |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | |
| Distribution | S/O | S/O | SGD 333 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 34 |
| VNI par action | S/O | S/O | SGD 9,93 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 253 248 | \$ 403 078 | \$ 164 345 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 87 830 | \$ 83 455 | \$ 68 012 |
| Actions émises en circulation | 7 446 | 7 503 | 5 798 |
| VNI par action | \$ 11,80 | \$ 11,12 | \$ 11,73 |
| Institutions en EUR (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 28 298 | € 82 243 | € 4 749 |
| Actions émises en circulation | 2 902 | 8 718 | 477 |
| VNI par action | € 9,75 | € 9,43 | € 9,96 |
| Institutions en GBP (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 3 181 | £ 3 543 | £ 22 843 |
| Actions émises en circulation | 266 | 308 | 1 924 |
| VNI par action | £ 11,96 | £ 11,50 | £ 11,87 |
| Administrations : | | | |
| Distribution II | \$ 1 963 | \$ 2 961 | S/O |
| Actions émises en circulation | 223 | 338 | S/O |
| VNI par action | \$ 8,78 | \$ 8,75 | S/O |
| Administrations en SGD (couverte) : | | | |
| Distribution II | SGD 5 209 | SGD 10 723 | S/O |
| Actions émises en circulation | 585 | 1 197 | S/O |
| VNI par action | SGD 8,90 | SGD 8,95 | S/O |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 44 395 | \$ 85 842 | \$ 14 809 |
| Actions émises en circulation | 4 268 | 8 673 | 1 405 |
| VNI par action | \$ 10,40 | \$ 9,90 | \$ 10,54 |
| Distribution II | \$ 10 | \$ 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 9,35 | \$ 9,27 | S/O |
| Catégorie E en AUD (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | AUD 346 | AUD 334 | S/O |
| Actions émises en circulation | 36 | 36 | S/O |
| VNI par action | AUD 9,67 | AUD 9,35 | S/O |
| Catégorie E en EUR (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 64 630 | € 110 990 | € 33 996 |
| Actions émises en circulation | 6 803 | 11 966 | 3 436 |
| VNI par action | € 9,50 | € 9,28 | € 9,89 |
| Distribution | € 7 161 | € 11 302 | € 5 738 |
| Actions émises en circulation | 833 | 1 312 | 608 |
| VNI par action | € 8,59 | € 8,61 | € 9,43 |
| Catégorie E en GBP (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 8 | £ 8 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | £ 9,69 | £ 9,41 | S/O |
| Catégorie E en SGD (partiellement couverte) : | | | |
| Capitalisation | SGD 14 | SGD 13 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | SGD 9,67 | SGD 9,35 | S/O |
| H Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 10 | \$ 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 10,00 | \$ 9,45 | S/O |
| M Détail : | | | |
| Distribution II | \$ 216 | \$ 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 23 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 9,47 | \$ 9,32 | S/O |
| Fonds Low Average Duration Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 809 845 | \$ 1 072 758 | \$ 1 179 138 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 520 962 | \$ 640 710 | \$ 747 732 |
| Actions émises en circulation | 31 818 | 41 077 | 45 606 |
| VNI par action | \$ 16,37 | \$ 15,60 | \$ 16,40 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | | |
|----------------------------------|---|--|------------------------|---------|------------------------|---------|--|
| | Fonds Low Average Duration Fund (suite) | | | | | | |
| Distribution | \$ | 33 698 | \$ | 53 185 | \$ | 33 312 | |
| Actions émises en circulation | | 3 350 | | 5 377 | | 3 159 | |
| VNI par action | \$ | 10,06 | \$ | 9,89 | \$ | 10,54 | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 23 355 | € | 37 536 | € | 35 456 | |
| Actions émises en circulation | | 2 338 | | 3 864 | | 3 402 | |
| VNI par action | € | 9,99 | € | 9,71 | € | 10,42 | |
| Distribution | € | 3 340 | € | 8 986 | € | 10 023 | |
| Actions émises en circulation | | 474 | | 1 270 | | 1 302 | |
| VNI par action | € | 7,05 | € | 7,08 | € | 7,70 | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 17 595 | £ | 17 044 | £ | 13 877 | |
| Actions émises en circulation | | 1 730 | | 1 748 | | 1 347 | |
| VNI par action | £ | 10,17 | £ | 9,75 | £ | 10,30 | |
| Distribution | £ | 2 381 | £ | 3 285 | £ | 4 225 | |
| Actions émises en circulation | | 264 | | 367 | | 439 | |
| VNI par action | £ | 9,01 | £ | 8,95 | £ | 9,64 | |
| Investisseurs : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 10 761 | \$ | 16 532 | \$ | 20 960 | |
| Actions émises en circulation | | 703 | | 1 131 | | 1 359 | |
| VNI par action | \$ | 15,30 | \$ | 14,62 | \$ | 15,42 | |
| Distribution | \$ | 1 454 | \$ | 2 022 | \$ | 7 973 | |
| Actions émises en circulation | | 146 | | 206 | | 762 | |
| VNI par action | \$ | 9,98 | \$ | 9,81 | \$ | 10,46 | |
| Administrations : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 8 728 | \$ | 10 755 | \$ | 11 016 | |
| Actions émises en circulation | | 587 | | 755 | | 733 | |
| VNI par action | \$ | 14,87 | \$ | 14,24 | \$ | 15,04 | |
| Catégorie E : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 37 888 | \$ | 47 980 | \$ | 52 498 | |
| Actions émises en circulation | | 3 020 | | 3 979 | | 4 104 | |
| VNI par action | \$ | 12,55 | \$ | 12,06 | \$ | 12,79 | |
| Distribution | \$ | 4 074 | \$ | 5 384 | \$ | 6 751 | |
| Actions émises en circulation | | 393 | | 528 | | 621 | |
| VNI par action | \$ | 10,37 | \$ | 10,20 | \$ | 10,87 | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 15 764 | € | 25 480 | € | 18 812 | |
| Actions émises en circulation | | 1 966 | | 3 238 | | 2 209 | |
| VNI par action | € | 8,02 | € | 7,87 | € | 8,52 | |
| H Institutions : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 113 500 | \$ | 186 190 | \$ | 186 367 | |
| Actions émises en circulation | | 9 245 | | 15 891 | | 15 108 | |
| VNI par action | \$ | 12,28 | \$ | 11,72 | \$ | 12,34 | |
| Distribution | \$ | 1 267 | \$ | 1 521 | \$ | 7 574 | |
| Actions émises en circulation | | 131 | | 159 | | 745 | |
| VNI par action | \$ | 9,69 | \$ | 9,54 | \$ | 10,16 | |
| Catégorie R : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 5 145 | \$ | 7 183 | \$ | 7 325 | |
| Actions émises en circulation | | 470 | | 687 | | 665 | |
| VNI par action | \$ | 10,94 | \$ | 10,45 | \$ | 11,02 | |
| Actifs nets | | | | | | | |
| | | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | | | | |
| | \$ | 972 843 | \$ | 654 749 | \$ | 806 869 | |
| Institutions : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 260 504 | \$ | 120 881 | \$ | 94 445 | |
| Actions émises en circulation | | 21 237 | | 10 562 | | 7 805 | |
| VNI par action | \$ | 12,27 | \$ | 11,44 | \$ | 12,10 | |
| Distribution | \$ | 17 872 | \$ | 17 001 | \$ | 10 | |
| Actions émises en circulation | | 1 864 | | 1 859 | | 1 | |
| VNI par action | \$ | 9,59 | \$ | 9,15 | \$ | 9,82 | |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | | |
|----------------------------------|--|--------------------------------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|--|
| | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite) | | | | | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 547 196 | € | 417 993 | € | 520 319 | |
| Actions émises en circulation | | 52 295 | | 41 937 | | 48 370 | |
| VNI par action | € | 10,46 | € | 9,97 | € | 10,76 | |
| Distribution | € | 82 | € | 133 | € | 928 | |
| Actions émises en circulation | | 9 | | 15 | | 95 | |
| VNI par action | € | 9,15 | € | 8,90 | € | 9,75 | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 16 669 | £ | 18 388 | £ | 18 462 | |
| Actions émises en circulation | | 1 453 | | 1 708 | | 1 611 | |
| VNI par action | £ | 11,47 | £ | 10,77 | £ | 11,46 | |
| Distribution | £ | 3 766 | £ | 3 910 | £ | 18 096 | |
| Actions émises en circulation | | 404 | | 432 | | 1 849 | |
| VNI par action | £ | 9,33 | £ | 9,06 | £ | 9,79 | |
| Institutions en NOK (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | NOK | 29 300 | NOK | 159 169 | NOK | 441 039 | |
| Actions émises en circulation | | 276 | | 1 581 | | 4 119 | |
| VNI par action | NOK | 106,05 | NOK | 100,63 | NOK | 107,06 | |
| Institutions en SEK (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | SEK | 313 000 | | S/O | | S/O | |
| Actions émises en circulation | | 3 016 | | S/O | | S/O | |
| VNI par action | SEK | 103,77 | | S/O | | S/O | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 27 087 | € | 25 901 | € | 17 694 | |
| Actions émises en circulation | | 2 831 | | 2 816 | | 1 767 | |
| VNI par action | € | 9,57 | € | 9,20 | € | 10,01 | |
| Actifs nets | | | | | | | |
| | | Fonds Low Duration Income Fund | | | | | |
| | \$ | 2 030 305 | \$ | 1 084 380 | \$ | 1 367 475 | |
| Institutions : | | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 234 711 | \$ | 186 357 | \$ | 275 963 | |
| Actions émises en circulation | | 19 914 | | 17 111 | | 24 381 | |
| VNI par action | \$ | 11,79 | \$ | 10,89 | \$ | 11,32 | |
| Distribution | \$ | 302 944 | \$ | 11 734 | \$ | 13 398 | |
| Actions émises en circulation | | 30 756 | | 1 229 | | 1 305 | |
| VNI par action | \$ | 9,85 | \$ | 9,56 | \$ | 10,27 | |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | CHF | 1 854 | |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 178 | |
| VNI par action | | S/O | | S/O | CHF | 10,43 | |
| Capitalisation | CHF | 61 554 | | S/O | | S/O | |
| Actions émises en circulation | | 5 917 | | S/O | | S/O | |
| VNI par action | CHF | 10,40 | | S/O | | S/O | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | | |
| Capitalisation | € | 715 038 | € | 633 070 | € | 666 067 | |
| Actions émises en circulation | | 67 973 | | 63 769 | | 63 153 | |
| VNI par action | € | 10,52 | € | 9,93 | € | 10,55 | |
| Distribution | € | 9 | € | 8 | € | 60 301 | |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | 6 036 | |
| VNI par action | € | 9,22 | € | 9,14 | € | 9,99 | |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--------------------------------------|--|---------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Low Duration Income Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 215 265 | £ | 3 280 | £ | 5 158 |
| Actions émises en circulation | | 19 315 | | 316 | | 475 |
| VNI par action | £ | 11,14 | £ | 10,37 | £ | 10,85 |
| Distribution | £ | 117 567 | £ | 50 073 | £ | 130 935 |
| Actions émises en circulation | | 12 705 | | 5 539 | | 13 372 |
| VNI par action | £ | 9,25 | £ | 9,04 | £ | 9,79 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 19 310 | SGD | 15 840 | SGD | 19 822 |
| Actions émises en circulation | | 1 789 | | 1 566 | | 1 883 |
| VNI par action | SGD | 10,79 | SGD | 10,12 | SGD | 10,53 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | € | 639 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 61 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 10,41 |
| Distribution | | S/O | | S/O | € | 452 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 48 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 9,46 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 56 816 | \$ | 27 537 | \$ | 16 491 |
| Actions émises en circulation | | 5 058 | | 2 629 | | 1 502 |
| VNI par action | \$ | 11,23 | \$ | 10,47 | \$ | 10,98 |
| Distribution | \$ | 7 583 | \$ | 8 193 | \$ | 9 075 |
| Actions émises en circulation | | 802 | | 885 | | 904 |
| VNI par action | \$ | 9,45 | \$ | 9,25 | \$ | 10,04 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 85 839 | € | 31 442 | € | 16 611 |
| Actions émises en circulation | | 8 571 | | 3 297 | | 1 625 |
| VNI par action | € | 10,01 | € | 9,54 | € | 10,22 |
| Distribution | € | 9 989 | € | 2 708 | € | 1 014 |
| Actions émises en circulation | | 1 188 | | 322 | | 109 |
| VNI par action | € | 8,41 | € | 8,42 | € | 9,34 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | SGD | 721 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 73 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | SGD | 9,90 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 17 331 | \$ | 62 043 | \$ | 3 622 |
| Actions émises en circulation | | 1 587 | | 6 136 | | 344 |
| VNI par action | \$ | 10,92 | \$ | 10,11 | \$ | 10,53 |
| Distribution | \$ | 3 119 | \$ | 418 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 324 | | 45 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 9,62 | \$ | 9,34 | | S/O |
| Catégorie Z en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | € | 9 | € | 10 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 1 | | 1 |
| VNI par action | | S/O | € | 10,21 | € | 10,79 |
| Actifs nets | \$ | 787 624 | \$ | 1 345 781 | \$ | 3 217 260 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 93 820 | \$ | 61 036 | \$ | 142 348 |
| Actions émises en circulation | | 8 007 | | 5 569 | | 12 027 |
| VNI par action | \$ | 11,72 | \$ | 10,96 | \$ | 11,84 |
| Distribution | \$ | 25 780 | \$ | 33 224 | \$ | 41 508 |
| Actions émises en circulation | | 2 619 | | 3 555 | | 4 051 |
| VNI par action | \$ | 9,84 | \$ | 9,35 | \$ | 10,25 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 16 441 | € | 23 753 | € | 41 652 |
| Actions émises en circulation | | 1 637 | | 2 478 | | 3 940 |
| VNI par action | € | 10,04 | € | 9,58 | € | 10,57 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--------------------------------------|---|---------|------------------------|---------|------------------------|-----------|
| | Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite) | | | | | |
| Distribution | € | 219 | € | 10 599 | € | 12 374 |
| Actions émises en circulation | | 25 | | 1 244 | | 1 297 |
| VNI par action | € | 8,78 | € | 8,52 | € | 9,54 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 236 099 | £ | 713 035 | £ | 1 734 093 |
| Actions émises en circulation | | 21 651 | | 69 498 | | 155 485 |
| VNI par action | £ | 10,90 | £ | 10,26 | £ | 11,15 |
| Distribution | £ | 268 433 | £ | 288 970 | £ | 447 455 |
| Actions émises en circulation | | 28 510 | | 31 985 | | 44 752 |
| VNI par action | £ | 9,42 | £ | 9,03 | £ | 10,00 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 2 996 | € | 4 406 | € | 8 109 |
| Actions émises en circulation | | 316 | | 485 | | 806 |
| VNI par action | € | 9,49 | € | 9,09 | € | 10,06 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 2 828 | € | 3 102 | € | 4 360 |
| Actions émises en circulation | | 307 | | 350 | | 443 |
| VNI par action | € | 9,21 | € | 8,86 | € | 9,84 |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 10 | \$ | 1 534 | \$ | 2 989 |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 166 | | 301 |
| VNI par action | \$ | 9,93 | \$ | 9,24 | \$ | 9,93 |
| Actifs nets | \$ | 5 221 | \$ | 4 928 | | |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 4 672 | \$ | 4 426 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 447 | | 446 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,45 | \$ | 9,90 | | S/O |
| Distribution | \$ | 10 | \$ | 10 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,02 | \$ | 9,81 | | S/O |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 233 | € | 225 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 23 | | 23 | | S/O |
| VNI par action | € | 10,11 | € | 9,78 | | S/O |
| Distribution | € | 9 | € | 9 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | € | 9,69 | € | 9,69 | | S/O |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 204 | £ | 194 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 20 | | 20 | | S/O |
| VNI par action | £ | 10,33 | £ | 9,85 | | S/O |
| Distribution | £ | 8 | £ | 8 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | £ | 9,86 | £ | 9,75 | | S/O |
| Actifs nets | \$ | 98 493 | \$ | 120 137 | \$ | 100 538 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 13 881 | \$ | 21 492 | \$ | 21 487 |
| Actions émises en circulation | | 1 194 | | 2 114 | | 2 658 |
| VNI par action | \$ | 11,62 | \$ | 10,17 | \$ | 8,08 |
| Distribution | \$ | 8 737 | \$ | 10 469 | \$ | 29 680 |
| Actions émises en circulation | | 1 274 | | 1 678 | | 5 697 |
| VNI par action | \$ | 6,86 | \$ | 6,24 | \$ | 5,21 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 37 825 | € | 41 892 | € | 19 141 |
| Actions émises en circulation | | 3 910 | | 4 844 | | 2 714 |
| VNI par action | € | 9,67 | € | 8,65 | € | 7,05 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|----------------------------------|--|-----------------------------------|------------------------|---------|------------------------|-----------|
| | Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (suite) | | | | | |
| Distribution | € | 1 792 | € | 3 309 | € | 2 062 |
| Actions émises en circulation | | 315 | | 625 | | 455 |
| VNI par action | € | 5,69 | € | 5,29 | € | 4,54 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 1 418 | £ | 1 415 | £ | 1 362 |
| Actions émises en circulation | | 143 | | 162 | | 193 |
| VNI par action | £ | 9,94 | £ | 8,76 | £ | 7,07 |
| Distribution | | S/O | | S/O | £ | 25 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 5 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | £ | 4,51 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | \$ | 1 183 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 117 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 10,09 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Distribution | \$ | 20 293 | \$ | 23 893 | \$ | 10 905 |
| Actions émises en circulation | | 3 294 | | 4 223 | | 2 287 |
| VNI par action | \$ | 6,16 | \$ | 5,66 | \$ | 4,77 |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 10 013 | \$ | 14 340 | \$ | 11 293 |
| Actions émises en circulation | | 674 | | 1 113 | | 1 113 |
| VNI par action | \$ | 14,87 | \$ | 12,88 | \$ | 10,14 |
| | | Fonds Mortgage Opportunities Fund | | | | |
| Actifs nets | \$ | 925 256 | \$ | 849 148 | \$ | 2 238 424 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 418 366 | \$ | 409 011 | \$ | 558 563 |
| Actions émises en circulation | | 36 426 | | 38 104 | | 47 581 |
| VNI par action | \$ | 11,49 | \$ | 10,73 | \$ | 11,74 |
| Distribution | \$ | 36 446 | \$ | 94 373 | \$ | 351 769 |
| Actions émises en circulation | | 4 056 | | 10 759 | | 35 231 |
| VNI par action | \$ | 8,99 | \$ | 8,77 | \$ | 9,98 |
| Institutions en CAD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CAD | 41 430 | CAD | 23 438 | CAD | 25 659 |
| Actions émises en circulation | | 4 206 | | 2 532 | | 2 532 |
| VNI par action | CAD | 9,85 | CAD | 9,26 | CAD | 10,14 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 2 643 | CHF | 3 010 | CHF | 5 577 |
| Actions émises en circulation | | 275 | | 322 | | 532 |
| VNI par action | CHF | 9,59 | CHF | 9,34 | CHF | 10,47 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 251 283 | € | 192 977 | € | 317 357 |
| Actions émises en circulation | | 25 105 | | 20 209 | | 29 769 |
| VNI par action | € | 10,01 | € | 9,55 | € | 10,66 |
| Distribution | € | 9 804 | € | 14 970 | € | 26 722 |
| Actions émises en circulation | | 1 252 | | 1 923 | | 2 953 |
| VNI par action | € | 7,83 | € | 7,78 | € | 9,05 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 4 831 | £ | 7 355 | £ | 19 288 |
| Actions émises en circulation | | 449 | | 727 | | 1 733 |
| VNI par action | £ | 10,76 | £ | 10,12 | £ | 11,13 |
| Distribution | £ | 10 837 | £ | 6 104 | £ | 5 764 |
| Actions émises en circulation | | 1 289 | | 740 | | 609 |
| VNI par action | £ | 8,40 | £ | 8,25 | £ | 9,46 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 19 812 | \$ | 20 219 | \$ | 32 611 |
| Actions émises en circulation | | 1 804 | | 1 963 | | 2 885 |
| VNI par action | \$ | 10,98 | \$ | 10,30 | \$ | 11,30 |
| Distribution | \$ | 5 989 | \$ | 4 762 | \$ | 19 104 |
| Actions émises en circulation | | 666 | | 543 | | 1 914 |
| VNI par action | \$ | 8,99 | \$ | 8,77 | \$ | 9,98 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|---------------------------------|---|------------------------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite) | | | | | |
| Administrations : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | \$ | 44 | \$ | 540 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 5 | | 54 |
| VNI par action | | S/O | \$ | 8,77 | \$ | 9,98 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 59 228 | \$ | 43 823 | \$ | 58 797 |
| Actions émises en circulation | | 5 485 | | 4 304 | | 5 232 |
| VNI par action | \$ | 10,80 | \$ | 10,18 | \$ | 11,24 |
| Distribution | \$ | 11 408 | \$ | 4 351 | \$ | 10 154 |
| Actions émises en circulation | | 1 271 | | 496 | | 1 017 |
| VNI par action | \$ | 8,97 | \$ | 8,77 | \$ | 9,99 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | CHF | 166 | CHF | 319 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 22 | | 36 |
| VNI par action | | S/O | CHF | 7,55 | CHF | 8,82 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 10 172 | € | 12 803 | € | 16 220 |
| Actions émises en circulation | | 1 082 | | 1 415 | | 1 591 |
| VNI par action | € | 9,40 | € | 9,05 | € | 10,20 |
| Distribution | | S/O | | S/O | € | 151 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 17 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 8,98 |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | | S/O | | S/O | SGD | 1 645 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 168 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | SGD | 9,78 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 3 119 | \$ | 39 | \$ | 71 |
| Actions émises en circulation | | 295 | | 4 | | 7 |
| VNI par action | \$ | 10,56 | \$ | 9,88 | \$ | 10,83 |
| Distribution | \$ | 935 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 91 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,32 | | S/O | | S/O |
| Catégorie Z : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 15 772 | \$ | 10 | \$ | 214 716 |
| Actions émises en circulation | | 1 497 | | 1 | | 19 628 |
| VNI par action | \$ | 10,54 | \$ | 9,78 | \$ | 10,94 |
| Catégorie Z en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | £ | 384 109 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 34 658 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | £ | 11,08 |
| | | Fonds StocksPLUS™ Fund | | | | |
| Actifs nets | \$ | 1 962 988 | \$ | 1 008 739 | \$ | 3 761 156 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 1 336 603 | \$ | 581 668 | \$ | 2 349 757 |
| Actions émises en circulation | | 22 608 | | 12 422 | | 39 164 |
| VNI par action | \$ | 59,12 | \$ | 46,83 | \$ | 60,00 |
| Distribution | \$ | 33 385 | \$ | 24 829 | \$ | 39 901 |
| Actions émises en circulation | | 811 | | 734 | | 913 |
| VNI par action | \$ | 41,15 | \$ | 33,81 | \$ | 43,69 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|----------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| | Fonds StocksPLUS™ Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 135 929 | € | 131 649 | € | 570 050 |
| Actions émises en circulation | | 4 150 | | 4 953 | | 16 237 |
| VNI par action | € | 32,75 | € | 26,58 | € | 35,11 |
| Distribution | | S/O | | S/O | € | 2 081 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 68 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 30,66 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | £ | 3 922 | £ | 199 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 456 | | 18 |
| VNI par action | | S/O | £ | 8,60 | £ | 11,28 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | SGD | 335 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 38 | | S/O |
| VNI par action | | S/O | SGD | 8,76 | | S/O |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 26 850 | \$ | 19 778 | \$ | 21 609 |
| Actions émises en circulation | | 494 | | 458 | | 389 |
| VNI par action | \$ | 54,31 | \$ | 43,17 | \$ | 55,51 |
| BE Détail : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 6 299 | \$ | 9 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 588 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 10,72 | \$ | 8,66 | | S/O |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 214 093 | \$ | 165 517 | \$ | 175 651 |
| Actions émises en circulation | | 4 225 | | 4 087 | | 3 355 |
| VNI par action | \$ | 50,67 | \$ | 40,50 | \$ | 52,35 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 101 366 | € | 35 366 | € | 13 927 |
| Actions émises en circulation | | 6 177 | | 2 632 | | 777 |
| VNI par action | € | 16,41 | € | 13,44 | € | 17,91 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 83 630 | \$ | 33 724 | \$ | 504 831 |
| Actions émises en circulation | | 5 672 | | 2 884 | | 33 635 |
| VNI par action | \$ | 14,74 | \$ | 11,69 | \$ | 15,01 |
| Catégorie T : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | \$ | 2 673 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 124 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 21,50 |
| | | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | | | | |
| Actifs nets | \$ | 11 175 | \$ | 9 528 | \$ | 11 610 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 11 175 | \$ | 9 327 | \$ | 10 848 |
| Actions émises en circulation | | 625 | | 663 | | 603 |
| VNI par action | \$ | 17,89 | \$ | 14,07 | \$ | 17,97 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | € | 405 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 24 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | € | 17,09 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | £ | 167 | £ | 198 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | 19 | | 18 |
| VNI par action | | S/O | £ | 8,59 | £ | 11,24 |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | \$ | 34 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 2 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | \$ | 17,53 |
| | | Fonds Strategic Income Fund | | | | |
| Actifs nets | \$ | 449 949 | \$ | 506 557 | \$ | 619 928 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 20 423 | \$ | 21 761 | \$ | 33 080 |
| Actions émises en circulation | | 1 656 | | 1 939 | | 2 754 |
| VNI par action | \$ | 12,33 | \$ | 11,22 | \$ | 12,01 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|------------------------|-----------|------------------------|-----------|
| | Fonds Strategic Income Fund (suite) | | | | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 143 972 | € | 168 023 | € | 207 426 |
| Actions émises en circulation | | 10 480 | | 13 134 | | 14 906 |
| VNI par action | € | 13,74 | € | 12,79 | € | 13,92 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | £ | 219 | £ | 201 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 22 | | 21 | | S/O |
| VNI par action | £ | 10,01 | £ | 9,67 | | S/O |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 33 466 | \$ | 37 001 | \$ | 35 991 |
| Actions émises en circulation | | 2 314 | | 2 786 | | 2 509 |
| VNI par action | \$ | 14,46 | \$ | 13,28 | \$ | 14,34 |
| Distribution II | \$ | 17 325 | \$ | 18 150 | \$ | 18 959 |
| Actions émises en circulation | | 1 838 | | 1 989 | | 1 828 |
| VNI par action | \$ | 9,42 | \$ | 9,13 | \$ | 10,37 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 111 233 | € | 133 817 | € | 140 034 |
| Actions émises en circulation | | 8 879 | | 11 367 | | 10 837 |
| VNI par action | € | 12,53 | € | 11,77 | € | 12,92 |
| Distribution II | € | 66 793 | € | 76 984 | € | 94 373 |
| Actions émises en circulation | | 8 196 | | 9 528 | | 10 105 |
| VNI par action | € | 8,15 | € | 8,08 | € | 9,34 |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 13 470 | € | 15 503 | € | 17 708 |
| Actions émises en circulation | | 1 209 | | 1 475 | | 1 529 |
| VNI par action | € | 11,14 | € | 10,51 | € | 11,58 |
| Distribution | € | 7 135 | € | 8 019 | € | 8 185 |
| Actions émises en circulation | | 789 | | 908 | | 817 |
| VNI par action | € | 9,05 | € | 8,83 | € | 10,02 |
| | | Fonds Total Return Bond Fund | | | | |
| Actifs nets | \$ | 4 420 051 | \$ | 4 150 717 | \$ | 4 944 898 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 1 615 253 | \$ | 1 419 973 | \$ | 1 598 195 |
| Actions émises en circulation | | 52 631 | | 49 161 | | 46 882 |
| VNI par action | \$ | 30,69 | \$ | 28,88 | \$ | 34,09 |
| Distribution | \$ | 125 064 | \$ | 112 085 | \$ | 174 533 |
| Actions émises en circulation | | 8 283 | | 7 634 | | 9 829 |
| VNI par action | \$ | 15,10 | \$ | 14,68 | \$ | 17,76 |
| Institutions en CAD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | CAD | 12 612 | CAD | 13 555 | CAD | 26 323 |
| Actions émises en circulation | | 1 448 | | 1 587 | | 2 540 |
| VNI par action | CAD | 8,71 | CAD | 8,54 | CAD | 10,36 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 6 050 | CHF | 3 138 | CHF | 13 206 |
| Actions émises en circulation | | 608 | | 320 | | 1 111 |
| VNI par action | CHF | 9,96 | CHF | 9,79 | CHF | 11,88 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 393 477 | € | 388 231 | € | 358 693 |
| Actions émises en circulation | | 19 584 | | 20 056 | | 15 344 |
| VNI par action | € | 20,09 | € | 19,36 | € | 23,38 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|--------------------------------------|--------------------------------------|---------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| | Fonds Total Return Bond Fund (suite) | | | | | |
| Distribution | € | 215 481 | € | 212 408 | € | 260 110 |
| Actions émises en circulation | | 18 302 | | 18 120 | | 17 931 |
| VNI par action | € | 11,77 | € | 11,72 | € | 14,51 |
| Institutions en EUR (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 7 459 | € | 19 929 | € | 14 618 |
| Actions émises en circulation | | 269 | | 736 | | 488 |
| VNI par action | € | 27,78 | € | 27,06 | € | 29,97 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 7 797 | £ | 3 621 | £ | 5 534 |
| Actions émises en circulation | | 605 | | 296 | | 379 |
| VNI par action | £ | 12,89 | £ | 12,24 | £ | 14,59 |
| Distribution | £ | 19 631 | £ | 29 067 | £ | 43 763 |
| Actions émises en circulation | | 2 347 | | 3 543 | | 4 355 |
| VNI par action | £ | 8,36 | £ | 8,20 | £ | 10,05 |
| Institutions en ILS (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | | S/O | | S/O | ILS | 185 |
| Actions émises en circulation | | S/O | | S/O | | 13 |
| VNI par action | | S/O | | S/O | ILS | 14,41 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 7 871 | SGD | 7 941 | SGD | 21 940 |
| Actions émises en circulation | | 618 | | 652 | | 1 524 |
| VNI par action | SGD | 12,73 | SGD | 12,17 | SGD | 14,40 |
| Investisseurs : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 352 467 | \$ | 409 533 | \$ | 369 122 |
| Actions émises en circulation | | 12 551 | | 15 440 | | 11 750 |
| VNI par action | \$ | 28,08 | \$ | 26,52 | \$ | 31,41 |
| Distribution | \$ | 50 617 | \$ | 67 693 | \$ | 35 775 |
| Actions émises en circulation | | 3 305 | | 4 545 | | 1 987 |
| VNI par action | \$ | 15,31 | \$ | 14,89 | \$ | 18,01 |
| Investisseurs en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 2 342 | CHF | 2 893 | CHF | 4 784 |
| Actions émises en circulation | | 246 | | 307 | | 417 |
| VNI par action | CHF | 9,53 | CHF | 9,41 | CHF | 11,46 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 17 085 | € | 18 868 | € | 19 262 |
| Actions émises en circulation | | 909 | | 1 038 | | 874 |
| VNI par action | € | 18,80 | € | 18,18 | € | 22,03 |
| Administrations : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 128 181 | \$ | 130 283 | \$ | 159 690 |
| Actions émises en circulation | | 4 630 | | 4 975 | | 5 141 |
| VNI par action | \$ | 27,69 | \$ | 26,19 | \$ | 31,06 |
| Distribution | \$ | 51 477 | \$ | 4 583 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 5 263 | | 482 | | S/O |
| VNI par action | \$ | 9,78 | \$ | 9,51 | | S/O |
| Administrations en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 2 760 | € | 2 966 | € | 1 953 |
| Actions émises en circulation | | 246 | | 273 | | 148 |
| VNI par action | € | 11,20 | € | 10,84 | € | 13,16 |
| Administrations en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Distribution | SGD | 14 | | S/O | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 1 | | S/O | | S/O |
| VNI par action | SGD | 10,06 | | S/O | | S/O |
| Catégorie E : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 407 981 | \$ | 380 803 | \$ | 478 210 |
| Actions émises en circulation | | 15 599 | | 15 332 | | 16 167 |
| VNI par action | \$ | 26,15 | \$ | 24,84 | \$ | 29,58 |
| Distribution | \$ | 139 042 | \$ | 151 164 | \$ | 199 962 |
| Actions émises en circulation | | 12 101 | | 13 526 | | 14 801 |
| VNI par action | \$ | 11,49 | \$ | 11,18 | \$ | 13,51 |
| Catégorie E en CHF (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | CHF | 10 506 | CHF | 9 731 | CHF | 5 648 |
| Actions émises en circulation | | 1 250 | | 1 166 | | 553 |
| VNI par action | CHF | 8,40 | CHF | 8,34 | CHF | 10,22 |

| | Au 31 décembre 2023 | | Au 31 décembre 2022 | | Au 31 décembre 2021 | |
|---|--------------------------------------|---------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| | Fonds Total Return Bond Fund (suite) | | | | | |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 433 274 | € | 471 035 | € | 623 265 |
| Actions émises en circulation | | 25 285 | | 28 276 | | 30 705 |
| VNI par action | € | 17,14 | € | 16,66 | € | 20,30 |
| Distribution | € | 34 883 | € | 40 476 | € | 54 687 |
| Actions émises en circulation | | 4 443 | | 5 177 | | 5 655 |
| VNI par action | € | 7,85 | € | 7,82 | € | 9,67 |
| Catégorie E en EUR (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | S/O | € | 489 | € | 710 | |
| Actions émises en circulation | S/O | | 51 | | 67 | |
| VNI par action | S/O | € | 9,53 | € | 10,65 | |
| Catégorie E en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | S/O | HKD | 1 568 | HKD | 3 128 | |
| Actions émises en circulation | S/O | | 155 | | 259 | |
| VNI par action | S/O | HKD | 10,15 | HKD | 12,07 | |
| Catégorie E en SGD (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | SGD | 32 839 | SGD | 30 035 | SGD | 38 699 |
| Actions émises en circulation | | 874 | | 828 | | 894 |
| VNI par action | SGD | 37,59 | SGD | 36,28 | SGD | 43,30 |
| H Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 197 186 | \$ | 115 199 | \$ | 199 555 |
| Actions émises en circulation | | 6 643 | | 4 116 | | 6 033 |
| VNI par action | \$ | 29,68 | \$ | 27,98 | \$ | 33,08 |
| Distribution | \$ | 10 522 | \$ | 8 589 | \$ | 17 255 |
| Actions émises en circulation | | 1 137 | | 954 | | 1 585 |
| VNI par action | \$ | 9,26 | \$ | 9,00 | \$ | 10,89 |
| M Détail en HKD (non couverte) : | | | | | | |
| Distribution | HKD | 84 232 | HKD | 76 242 | HKD | 91 252 |
| Actions émises en circulation | | 9 270 | | 8 622 | | 8 552 |
| VNI par action | HKD | 9,09 | HKD | 8,84 | HKD | 10,67 |
| Catégorie R en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 2 254 | € | 2 836 | € | 5 974 |
| Actions émises en circulation | | 236 | | 308 | | 535 |
| VNI par action | € | 9,54 | € | 9,22 | € | 11,16 |
| Catégorie T : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 5 824 | \$ | 6 382 | \$ | 13 697 |
| Actions émises en circulation | | 567 | | 652 | | 1 172 |
| VNI par action | \$ | 10,27 | \$ | 9,79 | \$ | 11,69 |
| Catégorie T en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 4 804 | € | 4 426 | € | 4 561 |
| Actions émises en circulation | | 549 | | 518 | | 437 |
| VNI par action | € | 8,76 | € | 8,54 | € | 10,44 |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | | | | | |
| Actifs nets | \$ | 240 346 | \$ | 435 924 | \$ | 101 789 |
| Institutions : | | | | | | |
| Capitalisation | \$ | 92 466 | \$ | 183 555 | \$ | 70 982 |
| Actions émises en circulation | | 7 501 | | 14 361 | | 6 152 |
| VNI par action | \$ | 12,33 | \$ | 12,78 | \$ | 11,54 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | € | 5 945 | € | 121 520 | € | 11 436 |
| Actions émises en circulation | | 555 | | 10 765 | | 1 108 |
| VNI par action | € | 10,71 | € | 11,29 | € | 10,32 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | | | | |
| Capitalisation | £ | 245 | £ | 9 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 26 | | 1 | | S/O |
| VNI par action | £ | 9,51 | £ | 9,88 | | S/O |
| Distribution | £ | 46 771 | £ | 31 132 | | S/O |
| Actions émises en circulation | | 5 378 | | 3 333 | | S/O |
| VNI par action | £ | 8,70 | £ | 9,34 | | S/O |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|---|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite) | | | |
| Investisseurs : | | | |
| Capitalisation | \$ 4 741 | \$ 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 523 | 1 | S/O |
| VNI par action | \$ 9,06 | \$ 9,43 | S/O |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 9 | € 9 | S/O |
| Actions émises en circulation | 1 | 1 | S/O |
| VNI par action | € 8,87 | € 9,39 | S/O |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 12 105 | \$ 11 079 | \$ 2 886 |
| Actions émises en circulation | 1 078 | 941 | 269 |
| VNI par action | \$ 11,23 | \$ 11,78 | \$ 10,74 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 12 722 | € 17 465 | € 1 747 |
| Actions émises en circulation | 1 305 | 1 680 | 182 |
| VNI par action | € 9,75 | € 10,40 | € 9,61 |
| H Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 877 | \$ 43 | S/O |
| Actions émises en circulation | 90 | 4 | S/O |
| VNI par action | \$ 9,76 | \$ 10,13 | S/O |
| Catégorie Z : | | | |
| Capitalisation | \$ 49 591 | \$ 55 435 | \$ 12 929 |
| Actions émises en circulation | 4 534 | 4 958 | 1 299 |
| VNI par action | \$ 10,94 | \$ 11,18 | \$ 9,95 |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | | | |
| Actifs nets | £ 361 061 | £ 389 173 | £ 592 164 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | £ 43 923 | £ 46 355 | £ 75 231 |
| Actions émises en circulation | 2 210 | 2 532 | 3 348 |
| VNI par action | £ 19,87 | £ 18,31 | £ 22,47 |
| Distribution | £ 245 303 | £ 276 939 | £ 436 466 |
| Actions émises en circulation | 27 741 | 32 956 | 41 393 |
| VNI par action | £ 8,84 | £ 8,40 | £ 10,54 |
| Catégorie Z : | | | |
| Capitalisation | £ 71 835 | £ 65 879 | £ 80 467 |
| Actions émises en circulation | 7 715 | 7 715 | 7 715 |
| VNI par action | £ 9,31 | £ 8,54 | £ 10,43 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | | |
| Actifs nets | £ 324 768 | £ 325 020 | £ 425 748 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | £ 286 707 | £ 283 958 | £ 366 869 |
| Actions émises en circulation | 13 320 | 14 455 | 13 155 |
| VNI par action | £ 21,52 | £ 19,65 | £ 27,89 |
| Distribution | £ 38 061 | £ 41 062 | £ 58 879 |
| Actions émises en circulation | 3 228 | 3 656 | 3 578 |
| VNI par action | £ 11,79 | £ 11,23 | £ 16,45 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | | | |
| Actifs nets | \$ 1 872 887 | \$ 1 984 922 | \$ 3 923 786 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 681 351 | \$ 780 024 | \$ 1 665 090 |
| Actions émises en circulation | 16 860 | 21 785 | 40 803 |
| VNI par action | \$ 40,41 | \$ 35,80 | \$ 40,81 |
| Distribution | \$ 215 871 | \$ 233 780 | \$ 400 716 |
| Actions émises en circulation | 24 177 | 27 877 | 39 668 |
| VNI par action | \$ 8,93 | \$ 8,39 | \$ 10,10 |
| Institutions en CHF (couverte) : | | | |
| Capitalisation | S/O | S/O | CHF 2 738 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 222 |
| VNI par action | S/O | S/O | CHF 12,33 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|
| Fonds US High Yield Bond Fund (suite) | | | |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 219 196 | € 240 268 | € 482 095 |
| Actions émises en circulation | 7 285 | 8 811 | 15 170 |
| VNI par action | € 30,09 | € 27,27 | € 31,78 |
| Distribution | € 21 347 | € 33 678 | € 138 522 |
| Actions émises en circulation | 2 144 | 3 520 | 11 751 |
| VNI par action | € 9,96 | € 9,57 | € 11,79 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | |
| Capitalisation | £ 30 402 | £ 40 143 | £ 48 533 |
| Actions émises en circulation | 1 294 | 1 913 | 2 009 |
| VNI par action | £ 23,49 | £ 20,99 | £ 24,16 |
| Distribution | £ 2 283 | £ 1 108 | £ 5 115 |
| Actions émises en circulation | 269 | 138 | 522 |
| VNI par action | £ 8,48 | £ 8,04 | £ 9,80 |
| Institutions en SGD (couverte) : | | | |
| Capitalisation | S/O | S/O | SGD 374 |
| Actions émises en circulation | S/O | S/O | 37 |
| VNI par action | S/O | S/O | SGD 10,10 |
| Investisseurs : | | | |
| Capitalisation | \$ 240 439 | \$ 236 934 | \$ 434 782 |
| Actions émises en circulation | 6 689 | 7 413 | 11 894 |
| VNI par action | \$ 35,95 | \$ 31,96 | \$ 36,56 |
| Distribution | \$ 17 026 | \$ 20 862 | \$ 37 431 |
| Actions émises en circulation | 2 356 | 3 073 | 4 581 |
| VNI par action | \$ 7,23 | \$ 6,79 | \$ 8,17 |
| Investisseurs en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 2 811 | € 2 708 | € 3 173 |
| Actions émises en circulation | 104 | 110 | 110 |
| VNI par action | € 27,04 | € 24,59 | € 28,78 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 130 888 | \$ 132 559 | \$ 225 933 |
| Actions émises en circulation | 3 797 | 4 302 | 6 375 |
| VNI par action | \$ 34,47 | \$ 30,82 | \$ 35,44 |
| Distribution | \$ 68 093 | \$ 58 679 | \$ 124 742 |
| Actions émises en circulation | 7 147 | 6 557 | 11 581 |
| VNI par action | \$ 9,53 | \$ 8,95 | \$ 10,77 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 50 468 | € 56 406 | € 77 393 |
| Actions émises en circulation | 1 969 | 2 407 | 2 808 |
| VNI par action | € 25,63 | € 23,44 | € 27,56 |
| H Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 114 190 | \$ 88 253 | \$ 139 658 |
| Actions émises en circulation | 2 926 | 2 548 | 3 532 |
| VNI par action | \$ 39,02 | \$ 34,63 | \$ 39,54 |
| Distribution | \$ 5 515 | \$ 2 482 | \$ 3 370 |
| Actions émises en circulation | 625 | 299 | 337 |
| VNI par action | \$ 8,83 | \$ 8,29 | \$ 9,99 |
| M Détail : | | | |
| Distribution | \$ 16 293 | \$ 12 265 | \$ 4 154 |
| Actions émises en circulation | 1 687 | 1 351 | 381 |
| VNI par action | \$ 9,66 | \$ 9,08 | \$ 10,91 |
| Catégorie R : | | | |
| Capitalisation | \$ 4 113 | \$ 5 477 | \$ 4 914 |
| Actions émises en circulation | 258 | 387 | 304 |
| VNI par action | \$ 15,95 | \$ 14,17 | \$ 16,18 |
| Catégorie Z : | | | |
| Capitalisation | \$ 12 870 | \$ 8 528 | \$ 9 666 |
| Actions émises en circulation | 879 | 661 | 661 |
| VNI par action | \$ 14,65 | \$ 12,91 | \$ 14,63 |

| | Au 31 décembre 2023 | Au 31 décembre 2022 | Au 31 décembre 2021 |
|----------------------------------|--|------------------------|------------------------|
| | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | | |
| Actifs nets | \$ 480 861 | \$ 388 522 | \$ 878 100 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 232 236 | \$ 151 061 | \$ 132 646 |
| Actions émises en circulation | 20 229 | 14 307 | 10 461 |
| VNI par action | \$ 11,48 | \$ 10,56 | \$ 12,68 |
| Distribution | \$ 66 032 | \$ 61 577 | \$ 63 781 |
| Actions émises en circulation | 7 392 | 7 201 | 5 999 |
| VNI par action | \$ 8,93 | \$ 8,55 | \$ 10,63 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 80 273 | € 124 155 | € 214 560 |
| Actions émises en circulation | 8 188 | 13 447 | 18 908 |
| VNI par action | € 9,80 | € 9,23 | € 11,35 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | |
| Distribution II | £ 27 296 | £ 13 692 | £ 304 200 |
| Actions émises en circulation | 3 477 | 1 794 | 31 489 |
| VNI par action | £ 7,85 | £ 7,63 | £ 9,66 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 49 311 | \$ 21 852 | \$ 17 627 |
| Actions émises en circulation | 5 243 | 2 504 | 1 667 |
| VNI par action | \$ 9,40 | \$ 8,73 | \$ 10,58 |
| Distribution | \$ 7 652 | \$ 5 002 | \$ 8 025 |
| Actions émises en circulation | 844 | 576 | 743 |
| VNI par action | \$ 9,07 | \$ 8,68 | \$ 10,80 |
| H Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 2 160 | \$ 55 | S/O |
| Actions émises en circulation | 204 | 6 | S/O |
| VNI par action | \$ 10,56 | \$ 9,73 | S/O |
| | Fonds US Short-Term Fund | | |
| Actifs nets | \$ 1 854 206 | \$ 2 310 115 | \$ 2 650 198 |
| Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 573 993 | \$ 865 421 | \$ 835 096 |
| Actions émises en circulation | 47 741 | 76 197 | 73 558 |
| VNI par action | \$ 12,02 | \$ 11,36 | \$ 11,35 |
| Distribution | \$ 123 753 | \$ 131 027 | \$ 102 552 |
| Actions émises en circulation | 12 302 | 13 207 | 10 172 |
| VNI par action | \$ 10,06 | \$ 9,92 | \$ 10,08 |
| Institutions en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 68 515 | € 202 833 | € 233 199 |
| Actions émises en circulation | 6 659 | 20 470 | 23 092 |
| VNI par action | € 10,29 | € 9,91 | € 10,10 |
| Institutions en GBP (couverte) : | | | |
| Distribution | £ 207 | S/O | S/O |
| Actions émises en circulation | 21 | S/O | S/O |
| VNI par action | £ 10,07 | S/O | S/O |
| Investisseurs : | | | |
| Capitalisation | \$ 7 368 | \$ 12 829 | \$ 18 474 |
| Actions émises en circulation | 633 | 1 164 | 1 671 |
| VNI par action | \$ 11,63 | \$ 11,02 | \$ 11,06 |
| Catégorie E : | | | |
| Capitalisation | \$ 412 185 | \$ 412 347 | \$ 467 026 |
| Actions émises en circulation | 35 571 | 37 521 | 42 334 |
| VNI par action | \$ 11,59 | \$ 10,99 | \$ 11,03 |
| Catégorie E en EUR (couverte) : | | | |
| Capitalisation | € 18 008 | € 44 471 | € 9 227 |
| Actions émises en circulation | 1 824 | 4 656 | 944 |
| VNI par action | € 9,88 | € 9,55 | € 9,77 |
| H Institutions : | | | |
| Capitalisation | \$ 18 000 | \$ 22 367 | \$ 33 914 |
| Actions émises en circulation | 1 634 | 2 147 | 3 250 |
| VNI par action | \$ 11,01 | \$ 10,42 | \$ 10,44 |
| Catégorie Z : | | | |
| Distribution | \$ 623 066 | \$ 602 189 | \$ 917 450 |
| Actions émises en circulation | 61 599 | 60 375 | 90 541 |
| VNI par action | \$ 10,11 | \$ 9,97 | \$ 10,13 |

20. QUESTIONS RÉGLEMENTAIRES ET LITIGES

La Société n'est citée comme défendeur dans aucun litige ou procédure d'arbitrage important(e) et n'a connaissance d'aucun litige ou d'aucune réclamation important(e) effectué(e) ou n'en est pas menacée.

Ce qui précède ne s'applique qu'au 31 décembre 2023.

21. FACILITÉ DE CRÉDIT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc, agissant pour le compte de chacun des Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Global High Yield Bond Fund et US High Yield Bond Fund (les « Fonds », individuellement un « Fonds ») a contracté une quatrième facilité de crédit modifiée et mise à jour en date du 18 août 2023 (le « Contrat de crédit ») entre, notamment, les Fonds, certains prêteurs dont MUFG Bank Ltd. (« MUFG ») (en qualité de prêteur) et MUFG en qualité d'agent et de chef de file.

Chaque Fonds est autorisé à utiliser la facilité à titre temporaire conformément aux politiques d'investissement du Fonds concerné.

Sous réserve des conditions du Contrat de crédit, l'engagement total disponible et pouvant être utilisé par les Fonds est de 240 000 000 \$. Les sous-limites de chaque Fonds sont les suivantes : Fonds Global High Yield Bond Fund : 95 000 000 \$; Fonds US High Yield Bond Fund : 60 000 000 \$ et Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund : 85 000 000 \$. Le montant total disponible pour les Fonds, ainsi que pour les autres emprunteurs (collectivement, les « Emprunteurs ») est, sous réserve des conditions du Contrat de crédit, de 268 000 000 \$ (le « Montant total engagé »). Les Emprunteurs peuvent, sous réserve des conditions du Contrat de crédit, demander une augmentation du Montant total engagé allant jusqu'à 332 000 000 \$ (jusqu'à un montant engagé augmenté maximal de 600 000 000 \$). Cet engagement supplémentaire serait disponible pour être utilisé par les Emprunteurs conformément aux conditions du Contrat de crédit.

Le Contrat de crédit prévoit deux taux d'intérêt. Chaque Fonds, lorsqu'il utilise un prêt, choisira le taux d'intérêt qui s'appliquera à tout ou partie du prêt concerné, le taux applicable étant déterminé par référence au (i) Taux de base de substitution ou au (ii) SOFR simple quotidien ajusté.

Le Taux de base de substitution est, pour chaque jour donné, le taux le plus élevé entre (i) le taux directeur (tel que défini dans le Contrat de crédit) ou (ii) le Taux de financement bancaire au jour le jour (tel que défini dans le Contrat de crédit), en vigueur à cette date. Chaque prêt portant intérêt calculé par référence au Taux de base de substitution portera intérêt sur le principal en circulation pour la période commençant à la date à laquelle ce prêt est contracté jusqu'à la date à laquelle ce prêt est intégralement remboursé, sans tenir compte de la date à laquelle ce prêt est remboursé, à un taux annuel égal au Taux de base de substitution plus la Marge applicable (soit 1,125 %).

Le SOFR simple quotidien ajusté désigne un taux d'intérêt annuel égal (a) au SOFR simple quotidien (tel que défini dans le Contrat de crédit) plus (b) 0,10 %. Chaque prêt portant intérêt calculé par référence au SOFR simple quotidien ajusté portera intérêt sur le principal en circulation, pour la période commençant à la date à laquelle ce prêt est contracté ou repris jusqu'à la date à laquelle ce prêt est intégralement remboursé, en tenant compte de la date à laquelle ce prêt est remboursé, à un taux annuel égal au SOFR simple quotidien ajusté plus la Marge applicable (soit 1,125 %).

Sous réserve des conditions du Contrat de crédit, un prêt est remboursable à la première des deux dates suivantes : 60 jours après son tirage ou le 16 août 2024, à moins qu'il ne soit remboursable plus tôt conformément aux conditions du Contrat de crédit.

Tous les prêts sont fournis sans garantie et le recours des Prêteurs à un Fonds est limité aux actifs de ce Fonds.

Au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022, aucun des Fonds n'avait effectué d'emprunt en vertu des conditions du Contrat de crédit.

22. RÉGLEMENTATION RELATIVE AUX OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES

La Réglementation relative aux opérations de financement sur titres (« ROFT ») introduit des obligations de reporting et de communication sur les Opérations de financement sur titres (« OFT ») et les swaps de rendement total. Les OFT sont définies en particulier par l'Article 3(11) de la ROFT comme suit :

- un contrat de mise/prise en pension ;
- le prêt/l'emprunt de titres ou de matières premières ;
- une opération d'achat et revente ou de vente et rachat dos-à-dos ; ou
- une opération de prêt avec appel de marge.

(a) Données mondiales et concentration des contreparties OFT

Au 31 décembre 2023, les Fonds détenaient des swaps de rendement total et les types d'OFT suivants :

- Contrats de mise en pension
- Contrats de prise en pension
- Opérations par vente et rachat dos-à-dos

La juste valeur des actifs/(passifs) de tous les OFT et les swaps de rendement total au 31 décembre 2023, groupés par type(s) d'OFT et les dix plus importantes contreparties sont les suivantes (si le nombre de contreparties est inférieur à dix, toutes les contreparties sont identifiées).

| Fonds | 31 décembre 2023 | |
|--|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| SSB | \$ 3 856 | 0,16 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BPS | (12 951) | (0,53) |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| SSB | \$ 252 | 0,14 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BPS | (505) | (0,28) |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| CBK | \$ (34) | (0,01) |
| MEI | 28 | 0,01 |
| MYI | (261) | (0,04) |
| Total | (267) | (0,04) |
| Contrats de mise en pension | | |
| DEU | 9 600 | 1,43 |
| FICC | 2 484 | 0,37 |
| SSB | 520 | 0,08 |
| Total | 12 604 | 1,88 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 7 572 | 0,15 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BPS | (34 160) | (0,66) |
| BRC | (5 159) | (0,10) |
| IND | (29 387) | (0,57) |
| JPS | (42 901) | (0,84) |
| MYI | (13 355) | (0,26) |
| RCE | (2 375) | (0,05) |
| SCX | (52 323) | (1,02) |
| WFS | (52 545) | (1,02) |
| Total | (232 205) | (4,52) |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BOS | \$ 5 800 | 2,21 |
| Contrats de prise en pension | | |
| JML | (803) | (0,31) |

| Fonds | 31 décembre 2023 | |
|--|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds Commodity Real Return Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| BPS | \$ (394) | (0,05) |
| CBK | (588) | (0,07) |
| CIB | (27) | 0,00 |
| GST | (866) | (0,10) |
| JPM | (794) | (0,09) |
| MAC | (422) | (0,05) |
| MEI | (33) | (0,01) |
| SOG | (7) | 0,00 |
| Total | (3 131) | (0,37) |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | 40 300 | 4,69 |
| FICC | 42 718 | 4,98 |
| Total | 83 018 | 9,67 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BSN | (61 063) | (7,11) |
| CIB | (293 867) | (34,21) |
| GRE | (41 128) | (4,79) |
| Total | (396 058) | (46,11) |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| BPS | \$ (366) | (0,37) |
| Contrats de mise en pension | | |
| SSB | 737 | 0,74 |
| Contrats de prise en pension | | |
| GRE | (2 942) | (2,94) |
| Fonds Diversified Income Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BSN | \$ 83 422 | 1,12 |
| CEW | 910 056 | 12,24 |
| DEU | 81 400 | 1,09 |
| FICC | 104 525 | 1,40 |
| IND | 42 068 | 0,57 |
| Total | 1 221 471 | 16,42 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BPS | (1 261) | (0,02) |
| BRC | (22 929) | (0,31) |
| JML | (14 371) | (0,19) |
| MYI | (11 115) | (0,15) |
| Total | (49 676) | (0,67) |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | \$ 32 300 | 7,82 |
| BSN | 34 900 | 8,46 |
| FICC | 2 352 | 0,57 |
| Total | 69 552 | 16,85 |
| Contrats de prise en pension | | |
| JML | (529) | (0,13) |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BOS | \$ 3 000 | 5,21 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | \$ 382 440 | 11,10 |
| BRC | 136 900 | 3,97 |
| DEU | 160 000 | 4,64 |
| FICC | 55 076 | 1,60 |
| Total | 734 416 | 21,31 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BPS | (537) | (0,01) |
| JML | (192) | (0,01) |
| MBC | (625) | (0,02) |
| Total | (1 354) | (0,04) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | 31 décembre 2023 | | Fonds | 31 décembre 2023 | |
|--|-------------------------------|------------------------|--|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net | | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | | | Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | |
| Swaps de rendement total | | | Contrats de mise en pension SSB | \$ 158 | 0,79 |
| BOA | € (347) | (0,01) | Fonds PIMCO ESG Income Fund | | |
| BPS | (11) | 0,00 | Contrats de mise en pension BOS | \$ 8 200 | 3,02 |
| JPM | 30 | 0,00 | Fonds Euro Bond Fund | | |
| RBC | 67 | 0,00 | Contrats de mise en pension COM | € 95 300 | 5,70 |
| Total | (261) | (0,01) | FICC | 2 281 | 0,14 |
| Contrats de mise en pension | | | Total | 97 581 | 5,84 |
| BPS | 256 700 | 7,86 | Contrats de prise en pension BPS | (1 041) | (0,06) |
| CEW | 70 000 | 2,15 | Fonds Euro Credit Fund | | |
| FICC | 32 149 | 0,99 | Contrats de mise en pension BPS | € 13 700 | 2,55 |
| Total | 358 849 | 11,00 | FICC | 737 | 0,14 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | | | Total | 14 437 | 2,69 |
| Contrats de prise en pension | | | Contrats de prise en pension BPS | (1 403) | (0,26) |
| BPS | \$ (103 811) | (3,60) | JML | (6 045) | (1,12) |
| BRC | (154 191) | (5,36) | MBC | (728) | (0,14) |
| JML | (6 409) | (0,22) | Total | (8 176) | (1,52) |
| MBC | (16 938) | (0,59) | Fonds Euro Income Bond Fund | | |
| Total | (281 349) | (9,77) | Contrats de mise en pension COM | € 133 900 | 9,66 |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | | | FICC | 4 075 | 0,29 |
| Contrats de mise en pension | | | Total | 137 975 | 9,95 |
| BPS | \$ 15 600 | 15,23 | Contrats de prise en pension BPS | (324) | (0,03) |
| Contrats de prise en pension | | | BRC | (3 765) | (0,27) |
| BPS | (722) | (0,70) | JML | (179) | (0,01) |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | | | Total | (4 268) | (0,31) |
| Contrats de mise en pension | | | Fonds Euro Long Average Duration Fund | | |
| FICC | \$ 2 599 | 0,07 | Contrats de mise en pension BPS | € 50 700 | 5,48 |
| Contrats de prise en pension | | | FICC | 1 634 | 0,18 |
| BPS | (122 193) | (3,19) | Total | 52 334 | 5,66 |
| BRC | (7 473) | (0,19) | Contrats de prise en pension BRC | (10 485) | (1,13) |
| BSN | (180 824) | (4,70) | Fonds Euro Short-Term Fund | | |
| MYI | (5 169) | (0,13) | Contrats de mise en pension BPS | € 12 400 | 6,41 |
| NOM | (9 980) | (0,26) | Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | |
| SCX | (77 088) | (2,00) | Contrats de mise en pension BPS | € 30 300 | 8,24 |
| Total | (402 727) | (10,47) | Contrats de prise en pension BPS | (601) | (0,17) |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | | | MYI | (1 257) | (0,34) |
| Contrats de mise en pension | | | Total | (1 858) | (0,51) |
| DEU | \$ 3 400 | 0,13 | Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | | |
| FICC | 3 494 | 0,13 | Contrats de mise en pension BPS | € 1 000 | 0,77 |
| SAL | 6 800 | 0,25 | Fonds Global Advantage Fund | | |
| Total | 13 694 | 0,51 | Contrats de mise en pension FICC | \$ 534 | 0,12 |
| Contrats de prise en pension | | | Fonds Global Bond Fund | | |
| BPS | (74 306) | (2,76) | Contrats de mise en pension BPS | \$ 76 000 | 0,58 |
| BRC | (17 281) | (0,65) | CEW | 159 260 | 1,22 |
| BSN | (15 443) | (0,57) | FICC | 93 314 | 0,71 |
| MYI | (22 112) | (0,81) | IND | 43 343 | 0,33 |
| SCX | (49 858) | (1,85) | Total | 371 917 | 2,84 |
| TDM | (35 833) | (1,33) | Contrats de prise en pension BPS | (328) | 0,00 |
| Total | (214 833) | (7,97) | JML | (289) | 0,00 |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | Total | (617) | 0,00 |
| BRC | (44 884) | (1,66) | | | |
| GSC | (11 781) | (0,44) | | | |
| Total | (56 665) | (2,10) | | | |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | | | | | |
| Contrats de mise en pension | | | | | |
| FICC | \$ 993 | 0,63 | | | |
| Contrats de prise en pension | | | | | |
| BPS | (166) | (0,11) | | | |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | | | | |
| Contrats de mise en pension | | | | | |
| SSB | \$ 6 274 | 2,22 | | | |
| Contrats de prise en pension | | | | | |
| BOS | (5 271) | (1,86) | | | |

| Fonds | 31 décembre 2023 | | Fonds | 31 décembre 2023 | |
|--|-------------------------------|------------------------|--|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net | | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds Global Bond ESG Fund | | | Fonds Income Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | | Swaps de rendement total | | |
| BOS | \$ 91 000 | 2,56 | MYC | \$ (28) | 0,00 |
| FICC | 74 958 | 2,10 | Contrats de mise en pension | | |
| Total | 165 958 | 4,66 | CEW | 265 433 | 0,38 |
| | | | FICC | 9 035 | 0,01 |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | | | Total | 274 468 | 0,39 |
| Swaps de rendement total | | | Contrats de prise en pension | | |
| BPS | \$ (1 160) | (0,14) | JML | (495) | 0,00 |
| JPM | (368) | (0,05) | Fonds Income Fund II | | |
| MYC | (85) | (0,01) | Opérations de financement par vente et | | |
| Total | (1 613) | (0,20) | rachat dos-à-dos | | |
| Contrats de mise en pension | | | MSC | \$ (3 572) | (2,85) |
| FICC | 1 005 | 0,13 | Fonds Inflation Multi-Asset Fund | | |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | | | Swaps de rendement total | | |
| Contrats de prise en pension | | | BOA | \$ 0 | 0,00 |
| BPS | \$ (3 690) | (0,12) | CBK | (32) | (0,01) |
| BRC | (1 985) | (0,07) | JPM | (154) | (0,06) |
| BSN | (6 109) | (0,21) | MAC | (178) | (0,07) |
| JML | (6 912) | (0,23) | MYI | 0 | 0,00 |
| MYI | (1 421) | (0,05) | Total | (364) | (0,14) |
| TDM | (436) | (0,01) | Contrats de mise en pension | | |
| Total | (20 553) | (0,69) | SSB | 364 | 0,14 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | | | Contrats de prise en pension | | |
| Contrats de mise en pension | | | GRE | (15 063) | (5,95) |
| CEW | \$ 151 676 | 1,41 | Opérations de financement par vente et | | |
| DEU | 22 200 | 0,21 | rachat dos-à-dos | | |
| FICC | 3 237 | 0,03 | TDM | (1 229) | (0,49) |
| Total | 177 113 | 1,65 | Fonds Low Average Duration Fund | | |
| Contrats de prise en pension | | | Contrats de mise en pension | | |
| BPS | (4 457) | (0,04) | FICC | \$ 59 744 | 7,38 |
| BRC | (2 084) | (0,02) | JPS | 100 | 0,01 |
| JML | (1 287) | (0,01) | SAL | 40 900 | 5,05 |
| Total | (7 828) | (0,07) | Total | 100 744 | 12,44 |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | | Contrats de prise en pension | | |
| Contrats de mise en pension | | | STR | (525 595) | (64,90) |
| SSB | \$ 1 300 | 0,06 | Opérations de financement par vente et | | |
| Contrats de prise en pension | | | rachat dos-à-dos | | |
| BOS | (2 191) | (0,10) | MSC | (44 279) | (5,47) |
| BPS | (617) | (0,03) | Fonds Low Duration Global Investment | | |
| BRC | (30 730) | (1,42) | Grade Credit Fund | | |
| JML | (1 755) | (0,08) | Contrats de mise en pension | | |
| MBC | (382) | (0,02) | FICC | \$ 678 | 0,07 |
| SCX | (72 357) | (3,33) | Contrats de prise en pension | | |
| Total | (108 032) | (4,98) | BOS | (6 973) | (0,72) |
| Opérations de financement par vente et | | | Opérations de financement par vente et | | |
| rachat dos-à-dos | | | rachat dos-à-dos | | |
| BPG | (36 861) | (1,70) | BRC | (4 817) | (0,50) |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | | | Fonds Low Duration Income Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | | Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 2 889 | 0,25 | BOS | \$ 6 700 | 0,33 |
| Contrats de prise en pension | | | BRC | 65 000 | 3,20 |
| BOS | (3 872) | (0,33) | CEW | 204 763 | 10,09 |
| BRC | (9 365) | (0,80) | FICC | 69 021 | 3,40 |
| CIB | (604 777) | (51,38) | Total | 345 484 | 17,02 |
| Total | (618 014) | (52,51) | Fonds Low Duration Opportunities Fund | | |
| Opérations de financement par vente et | | | Contrats de mise en pension | | |
| rachat dos-à-dos | | | FICC | \$ 2 805 | 0,36 |
| BPG | (2 463) | (0,21) | Contrats de prise en pension | | |
| TDM | (22 223) | (1,89) | BPS | (268) | (0,04) |
| Total | (24 686) | (2,10) | SCX | (14 817) | (1,88) |
| Fonds Global Real Return Fund | | | Total | (15 085) | (1,92) |
| Contrats de mise en pension | | | Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure | | |
| FICC | \$ 2 878 | 0,12 | Fund | | |
| Contrats de prise en pension | | | Swaps de rendement total | | |
| CIB | (193 455) | (8,13) | BOA | \$ (113) | (0,12) |
| NOM | (378 792) | (15,91) | CBK | (13) | (0,01) |
| SCX | (70 474) | (2,96) | FAR | (3) | (0,00) |
| STR | (914 247) | (38,39) | JPM | (69) | (0,07) |
| Total | (1 556 968) | (65,39) | MYI | (53) | (0,05) |
| | | | Total | (251) | (0,25) |
| | | | Contrats de mise en pension | | |
| | | | SSB | 631 | 0,64 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | 31 décembre 2023 | |
|---|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | \$ 31 900 | 3,45 |
| FICC | 37 068 | 4,00 |
| Total | 68 968 | 7,45 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BOS | (55 855) | (6,04) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | |
| BPG | (823) | (0,09) |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| CBK | \$ (214) | (0,01) |
| FAR | (1 104) | (0,06) |
| JPM | (1 272) | (0,06) |
| RBC | (3 302) | (0,16) |
| TOR | (8) | 0,00 |
| UAG | (69) | (0,01) |
| Total | (5 969) | (0,30) |
| Contrats de mise en pension | | |
| BOS | 130 000 | 6,62 |
| BPS | 99 700 | 5,08 |
| BRC | 38 800 | 1,98 |
| DEU | 11 000 | 0,56 |
| FICC | 1 388 | 0,07 |
| GSC | 50 000 | 2,55 |
| SAL | 155 000 | 7,89 |
| TDM | 58 700 | 2,99 |
| Total | 544 588 | 27,74 |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| BOA | \$ (3) | (0,02) |
| BRC | (5) | (0,05) |
| CBK | (7) | (0,07) |
| RBC | (27) | (0,24) |
| Total | (42) | (0,38) |
| Contrats de mise en pension | | |
| BOS | 900 | 8,05 |
| SSB | 195 | 1,75 |
| Total | 1 095 | 9,80 |
| Fonds Strategic Income Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 605 | 0,13 |
| Contrats de prise en pension | | |
| GRE | (29 197) | (6,49) |
| SCX | (3 928) | (0,87) |
| Total | (33 125) | (7,36) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | |
| TDM | (1 037) | (0,23) |
| Fonds Total Return Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 732 | 0,02 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BRC | (1 947) | (0,04) |
| MBC | (1 299) | (0,03) |
| Total | (3 246) | (0,07) |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| MEI | \$ 506 | 0,21 |
| Contrats de mise en pension | | |
| DEU | 17 200 | 7,15 |
| SSB | 1 266 | 0,53 |
| Total | 18 466 | 7,68 |

| Fonds | 31 décembre 2023 | |
|--|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | £ 255 | 0,07 |
| SCX | 5 200 | 1,44 |
| Total | 5 455 | 1,51 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BPS | (506) | (0,14) |
| MEI | (20 086) | (5,56) |
| Total | (20 592) | (5,70) |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| SCX | £ 6 500 | 2,00 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BPS | (168) | (0,05) |
| CEW | (2 697) | (0,83) |
| MEI | (1 081) | (0,34) |
| Total | (3 946) | (1,22) |
| Fonds US High Yield Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 912 | 0,05 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BOS | (6 071) | (0,33) |
| BPS | (1 042) | (0,05) |
| MYI | (1 087) | (0,06) |
| Total | (8 200) | (0,44) |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 259 | 0,05 |
| Fonds US Short-Term Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 4 561 | 0,25 |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | |
| BPG | (32 279) | (1,74) |
| MSC | (11 615) | (0,63) |
| Total | (43 894) | (2,37) |

Au 31 décembre 2022, les Fonds détenaient des swaps de rendement total et les types d'OFT suivants :

- Contrats de mise en pension
- Contrats de prise en pension
- Opérations par vente et rachat dos-à-dos

La juste valeur des actifs/(passifs) de tous les OFT et les swaps de rendement total au 31 décembre 2022, groupés par type(s) d'OFT et les dix plus importantes contreparties sont les suivantes (si le nombre de contreparties est inférieur à dix, toutes les contreparties sont identifiées).

| Fonds | 31 décembre 2022 | |
|--|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| SSB | \$ 20 572 | 0,69 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| SSB | \$ 820 | 0,26 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| BOA | \$ 384 | 0,05 |
| BPS | 62 | 0,01 |
| BRC | (49) | (0,01) |
| GST | (2) | 0,00 |
| JPM | 192 | 0,03 |
| MBC | (33) | 0,00 |
| MEI | 7 | 0,00 |
| MYI | (122) | (0,03) |
| SOG | 118 | 0,02 |
| Total | 557 | 0,07 |

| Fonds | 31 décembre 2022 | | Fonds | 31 décembre 2022 | |
|---|-------------------------------|------------------------|--|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net | | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds | | | Fonds | | |
| Contrats de mise en pension | | | FICC | \$ 102 832 | 18,21 |
| BPS | \$ 7 300 | 0,97 | | | |
| FICC | 11 236 | 1,50 | Fonds Dynamic Bond Fund | | |
| Total | 18 536 | 2,47 | Contrats de mise en pension | | |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | | | BRC | \$ 1 055 700 | 30,31 |
| Contrats de mise en pension | | | FICC | 2 892 | 0,08 |
| FICC | \$ 10 172 | 0,18 | SAL | 87 100 | 2,50 |
| Contrats de prise en pension | | | Total | 1 145 692 | 32,89 |
| BPS | (71 348) | (1,25) | Contrats de prise en pension | | |
| BRC | (4 860) | (0,08) | DBL | (2 164) | (0,06) |
| BYR | (59 977) | (1,05) | Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | | |
| FBF | (2 857) | (0,05) | Swaps de rendement total | | |
| IND | (171 111) | (2,98) | BPS | € 440 | 0,01 |
| JML | (135 138) | (2,36) | JPM | 146 | 0,00 |
| SCX | (133 184) | (2,34) | MEI | 80 | 0,00 |
| Total | (578 475) | (10,11) | Total | 666 | 0,01 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | | | Contrats de mise en pension | | |
| Contrats de mise en pension | | | BPS | 22 818 | 0,45 |
| TDM | \$ 36 800 | 12,57 | CDI | 100 000 | 1,96 |
| Fonds Commodity Real Return Fund | | | FICC | 1 786 | 0,03 |
| Swaps de rendement total | | | Total | 124 604 | 2,44 |
| BPS | \$ (2 955) | (0,21) | Contrats de prise en pension | | |
| CBK | (2 457) | (0,18) | BPS | (17 828) | (0,35) |
| CIB | (334) | (0,02) | Fonds Emerging Local Bond Fund | | |
| FBF | (181) | (0,01) | Contrats de prise en pension | | |
| GST | (3 476) | (0,25) | BPS | \$ (39 132) | (2,04) |
| JPM | (345) | (0,03) | BRC | (46 181) | (2,41) |
| MAC | 1 137 | 0,08 | Total | (85 313) | (4,45) |
| MEI | (251) | (0,02) | Fonds Emerging Markets Bond Fund | | |
| SOG | (497) | (0,04) | Contrats de mise en pension | | |
| Total | (9 359) | (0,68) | FICC | \$ 9 160 | 0,28 |
| Contrats de mise en pension | | | Contrats de prise en pension | | |
| FICC | 613 | 0,04 | BPS | (36 659) | (1,11) |
| IND | 58 500 | 4,28 | BRC | (16 023) | (0,48) |
| Total | 59 113 | 4,32 | MBC | (1 622) | (0,05) |
| Contrats de prise en pension | | | MEI | (21 052) | (0,64) |
| BOS | (485) | (0,04) | Total | (75 356) | (2,28) |
| CIB | (331 976) | (24,23) | Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | | |
| GRE | (67 687) | (4,94) | Contrats de mise en pension | | |
| RCY | (25 154) | (1,84) | FICC | \$ 9 261 | 0,37 |
| Total | (425 302) | (31,05) | NOM | 35 400 | 1,42 |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | Total | 44 661 | 1,79 |
| BOS | (17 959) | (1,31) | Contrats de prise en pension | | |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | | BPS | (21 023) | (0,84) |
| Swaps de rendement total | | | BRC | (6 168) | (0,25) |
| BPS | \$ (160) | (0,16) | MEI | (4 460) | (0,18) |
| Contrats de mise en pension | | | NOM | (7 189) | (0,29) |
| BPS | 6 300 | 6,48 | Total | (38 840) | (1,56) |
| FICC | 610 | 0,63 | Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | | |
| Total | 6 910 | 7,11 | Contrats de mise en pension | | |
| Fonds Diversified Income Fund | | | BPS | \$ 6 100 | 3,61 |
| Contrats de mise en pension | | | FICC | 2 286 | 1,35 |
| BOS | \$ 500 000 | 5,71 | Total | 8 386 | 4,96 |
| BRC | 568 200 | 6,49 | Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | |
| CIB | 580 100 | 6,63 | Contrats de mise en pension | | |
| FICC | 41 323 | 0,47 | SSB | \$ 706 | 0,35 |
| MBC | 56 700 | 0,65 | Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | |
| Total | 1 746 323 | 19,95 | Contrats de mise en pension | | |
| Contrats de prise en pension | | | SAL | \$ 2 500 | 11,95 |
| BRC | (4 363) | (0,05) | SSB | 266 | 1,27 |
| JML | (2 283) | (0,03) | Total | 2 766 | 13,22 |
| Total | (6 646) | (0,08) | Fonds PIMCO ESG Income Fund | | |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | | | Contrats de mise en pension | | |
| Contrats de mise en pension | | | BPS | \$ 44 400 | 18,66 |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | 31 décembre 2022 | |
|---|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds Euro Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | € 10 900 | 0,57 |
| FICC | 615 | 0,03 |
| Total | 11 515 | 0,60 |
| Fonds Euro Credit Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | € 7 400 | 1,21 |
| FICC | 921 | 0,15 |
| IND | 36 300 | 5,95 |
| Total | 44 621 | 7,31 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | € 16 600 | 1,23 |
| COM | 100 000 | 7,38 |
| FICC | 3 858 | 0,29 |
| Total | 120 458 | 8,90 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | € 1 500 | 1,36 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | € 14 100 | 3,99 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | € 3 700 | 2,12 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | € 4 400 | 2,08 |
| Fonds Global Advantage Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 1 408 | 0,34 |
| Contrats de prise en pension | | |
| MEI | (1 504) | (0,37) |
| Fonds Global Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | \$ 660 000 | 5,77 |
| CIB | 562 700 | 4,93 |
| FICC | 124 270 | 1,09 |
| Total | 1 346 970 | 11,79 |
| Contrats de prise en pension | | |
| FBF | (1 682) | (0,01) |
| Fonds Global Bond ESG Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| BPS | \$ 275 900 | 8,88 |
| BRC | 313 900 | 10,11 |
| FICC | 568 047 | 18,29 |
| Total | 1 157 847 | 37,28 |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| BOA | \$ 182 | 0,03 |
| BPS | 315 | 0,04 |
| MYC | 21 | 0,00 |
| Total | 518 | 0,07 |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | 1 625 | 0,23 |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 7 812 | 0,25 |
| NOM | 3 600 | 0,12 |
| Total | 11 412 | 0,37 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BRC | (5 516) | (0,18) |
| FBF | (2 419) | (0,08) |
| JML | (2 462) | (0,08) |
| Total | (10 397) | (0,34) |

Fonds Global Investment Grade Credit Fund

| Fonds | 31 décembre 2022 | |
|---|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| DEU | \$ 30 800 | 0,29 |
| FICC | 29 223 | 0,28 |
| SAL | 15 400 | 0,15 |
| Total | 75 423 | 0,72 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BRC | (2 721) | (0,03) |
| JML | (1 433) | (0,01) |
| Total | (4 154) | (0,04) |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 1 053 | 0,08 |
| Contrats de prise en pension | | |
| CIB | (190 632) | (13,97) |
| DEU | (71 081) | (5,21) |
| Total | (261 713) | (19,18) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | |
| BRC | (69 575) | (5,10) |
| TDM | (10 024) | (0,73) |
| Total | (79 599) | (5,83) |
| Fonds Global Real Return Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | |
| FICC | \$ 2 245 | 0,09 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BOS | (14 838) | (0,58) |
| BRC | (3 159) | (0,12) |
| BSN | (554 549) | (21,56) |
| CIB | (171 691) | (6,68) |
| GRE | (51 915) | (2,02) |
| Total | (796 152) | (30,96) |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | |
| BOS | (9 519) | (0,37) |
| Fonds Income Fund | | |
| Swaps de rendement total | | |
| BOA | \$ 80 | 0,00 |
| GST | (735) | 0,00 |
| Total | (655) | 0,00 |
| Contrats de mise en pension | | |
| BOS | 500 000 | 0,86 |
| DEU | 116 100 | 0,20 |
| FICC | 2 037 659 | 3,51 |
| MBC | 644 900 | 1,11 |
| SGY | 113 800 | 0,20 |
| SOG | 9 239 | 0,02 |
| Total | 3 421 698 | 5,90 |
| Contrats de prise en pension | | |
| BRC | (5 155) | (0,01) |
| DBL | (10 712) | (0,02) |
| Total | (15 867) | (0,03) |

| Fonds | 31 décembre 2022 | | Fonds | 31 décembre 2022 | |
|---|-------------------------------|------------------------|---|-------------------------------|------------------------|
| | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net | | Juste valeur (en milliers) | En % de l'actif net |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | | | Fonds StocksPLUS™ Fund | | |
| Swaps de rendement total | | | Swaps de rendement total | | |
| BPS | \$ (373) | (0,09) | FAR | \$ (1 148) | (0,11) |
| BRC | (21) | (0,01) | MBC | (120) | (0,01) |
| CBK | (76) | (0,02) | RBC | (1 063) | (0,11) |
| GST | (118) | (0,03) | UBS | (35) | (0,01) |
| JPM | 17 | 0,00 | Total | (2 366) | (0,24) |
| MAC | 192 | 0,05 | Contrats de mise en pension | | |
| MYI | (362) | (0,09) | BOS | 20 300 | 2,01 |
| SOG | (48) | (0,01) | FICC | 14 743 | 1,46 |
| Total | (789) | (0,20) | NOM | 60 000 | 5,95 |
| Contrats de mise en pension | | | SGY | 24 500 | 2,43 |
| GSC | 37 700 | 9,34 | TOR | 36 902 | 3,67 |
| SSB | 3 020 | 0,76 | Total | 156 445 | 15,52 |
| Total | 40 720 | 10,10 | | | |
| Fonds Low Average Duration Fund | | | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | | Swaps de rendement total | | |
| FICC | \$ 956 | 0,09 | BRC | \$ (4) | (0,04) |
| Contrats de prise en pension | | | FAR | (16) | (0,16) |
| BOS | (128 895) | (12,01) | RBC | (17) | (0,19) |
| GRE | (15 962) | (1,49) | Total | (37) | (0,39) |
| Total | (144 857) | (13,50) | Contrats de mise en pension | | |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | BPS | 1 200 | 12,59 |
| CSN | (4 077) | (0,38) | SSB | 174 | 1,83 |
| | | | Total | 1 374 | 14,42 |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | | Fonds Strategic Income Fund | | |
| Contrats de mise en pension | | | Swaps de rendement total | | |
| FICC | \$ 1 604 | 0,24 | GST | \$ (4) | 0,00 |
| Contrats de prise en pension | | | Contrats de mise en pension | | |
| BOS | (2 415) | (0,37) | FICC | 781 | 0,15 |
| BRC | (607) | (0,09) | Fonds Total Return Bond Fund | | |
| GRE | (9 754) | (1,49) | Contrats de mise en pension | | |
| Total | (12 776) | (1,95) | BOS | \$ 26 100 | 0,63 |
| Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | | FICC | 144 795 | 3,49 |
| BPG | (1 409) | (0,22) | Total | 170 895 | 4,12 |
| | | | Contrats de prise en pension | | |
| Fonds Low Duration Income Fund | | | BRC | (1 745) | (0,04) |
| Swaps de rendement total | | | Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | |
| GST | \$ (2) | 0,00 | BPG | (76 809) | (1,85) |
| Contrats de mise en pension | | | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | |
| FICC | 5 431 | 0,50 | Swaps de rendement total | | |
| MBC | 93 400 | 8,61 | MEI | \$ (165) | (0,04) |
| Total | 98 831 | 9,11 | Contrats de mise en pension | | |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | | | BPS | 22 700 | 5,21 |
| Contrats de mise en pension | | | SSB | 4 752 | 1,09 |
| FICC | \$ 118 800 | 8,83 | Total | 27 452 | 6,30 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | | | Fonds UK Corporate Bond Fund | | |
| Swaps de rendement total | | | Contrats de mise en pension | | |
| BOA | \$ (130) | (0,10) | FICC | £ 177 | 0,05 |
| CBK | (8) | (0,01) | Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | | |
| FAR | (18) | (0,01) | Contrats de mise en pension | | |
| JPM | (1) | 0,00 | FICC | £ 269 | 0,08 |
| MYI | 16 | 0,01 | Fonds US High Yield Bond Fund | | |
| Total | (141) | (0,11) | Contrats de mise en pension | | |
| Contrats de mise en pension | | | FICC | \$ 9 269 | 0,47 |
| SSB | 811 | 0,68 | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | | |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | | | Contrats de mise en pension | | |
| Contrats de mise en pension | | | BOS | \$ 12 800 | 3,30 |
| BPS | \$ 13 700 | 1,61 | FICC | 2 583 | 0,66 |
| FICC | 3 618 | 0,43 | Total | 15 383 | 3,96 |
| Total | 17 318 | 2,04 | Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | | |
| Contrats de prise en pension | | | BPG | (38 655) | (9,95) |
| CIB | (264 111) | (31,10) | Fonds US Short-Term Fund | | |
| JPS | (724) | (0,09) | Contrats de mise en pension | | |
| RCY | (23 192) | (2,73) | FICC | \$ 154 472 | 6,69 |
| SCX | (28 466) | (3,35) | | | |
| Total | (316 493) | (37,27) | | | |

Notes relatives aux États financiers (suite)

(b) Garantie

(i) Garde des garanties reçues :

Les garanties reçues au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 sont détenues au sein du réseau de dépositaires international de State Street Bank and Trust en tant que société mère ultime du Dépositaire.

(ii) Données sur la concentration :

Les dix premiers émetteurs de titres reçus en garantie toutes OFT confondues au 31 décembre 2023 sont les suivants. Si le nombre d'émetteurs est inférieur à dix, tous les émetteurs sont identifiés ci-dessous :

| Fonds | Au 31 décembre 2023 | |
|---|-----------------------------|----------------------------|
| | Émetteur de garantie | Juste valeur (en milliers) |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 3 933 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 257 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Gouvernement des États-Unis | 12 888 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | Gouvernement des États-Unis | 7 724 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 5 930 |
| Fonds Commodity Real Return Fund | Gouvernement des États-Unis | 84 755 |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 752 |
| Fonds Diversified Income Fund | Gouvernement du Canada | 1 042 215 |
| | Gouvernement du Royaume-Uni | 43 772 |
| | Gouvernement des États-Unis | 189 743 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Gouvernement des États-Unis | 71 060 |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | Gouvernement des États-Unis | 3 067 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Freddie Mac | 104 |
| | Gouvernement du Royaume-Uni | 413 260 |
| | Gouvernement des États-Unis | 360 307 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Gouvernement de Belgique | € 253 574 |
| | Union européenne | 72 014 |
| | Gouvernement des États-Unis | 32 792 |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 15 987 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 2 651 |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | Gouvernement des États-Unis | 13 986 |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 013 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Gouvernement des États-Unis | 6 400 |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Gouvernement des États-Unis | 161 |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | Gouvernement des États-Unis | 8 383 |
| Fonds Euro Bond Fund | Gouvernement allemand | € 99 142 |
| | Gouvernement des États-Unis | 2 327 |
| Fonds Euro Credit Fund | Gouvernement de Belgique | 13 533 |
| | Gouvernement des États-Unis | 752 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | Gouvernement allemand | 137 888 |
| | Gouvernement des États-Unis | 4 156 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | Bpifrance SACA | 51 761 |
| | Gouvernement des États-Unis | 1 667 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | Bpifrance SACA | 12 736 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | Gouvernement de Belgique | 29 918 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Gouvernement de Belgique | 987 |
| Fonds Global Advantage Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 545 |
| Fonds Global Bond Fund | Gouvernement du Canada | 162 360 |
| | Gouvernement du Royaume-Uni | 45 099 |
| | Gouvernement des États-Unis | 172 784 |
| Fonds Global Bond ESG Fund | Gouvernement des États-Unis | 169 340 |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 025 |
| Global Investment Grade Credit Fund | Gouvernement du Canada | 159 576 |
| | Gouvernement des États-Unis | 25 972 |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 326 |

| Fonds | Au 31 décembre 2023 | |
|--|-----------------------------|----------------------------|
| | Émetteur de garantie | Juste valeur (en milliers) |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 2 947 |
| Fonds Global Real Return Fund | Gouvernement des États-Unis | 2 936 |
| Fonds Income Fund | Gouvernement du Canada | 271 720 |
| | Gouvernement des États-Unis | 9 216 |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | Gouvernement des États-Unis | 371 |
| Fonds Low Average Duration Fund | Gouvernement des États-Unis | 102 823 |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Gouvernement des États-Unis | 692 |
| Fonds Low Duration Income Fund | Gouvernement du Canada | 210 724 |
| | Gouvernement des États-Unis | 143 518 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Gouvernement des États-Unis | 2 861 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Gouvernement des États-Unis | 644 |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | Gouvernement des États-Unis | 70 406 |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | Freddie Mac | 40 217 |
| | Ginnie Mae | 135 354 |
| | Gouvernement des États-Unis | 384 551 |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 120 |
| Fonds Strategic Income Fund | Gouvernement des États-Unis | 617 |
| Fonds Total Return Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 747 |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Gouvernement des États-Unis | 18 899 |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | Gouvernement du Royaume-Uni | £ 5 300 |
| | Gouvernement des États-Unis | 260 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | Gouvernement du Royaume-Uni | 6 625 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 930 |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 264 |
| Fonds US Short-Term Fund | Gouvernement des États-Unis | 4 652 |

Les dix premiers émetteurs de titres reçus en garantie toutes OFT confondues au 31 décembre 2022 sont les suivants. Si le nombre d'émetteurs est inférieur à dix, tous les émetteurs sont identifiés ci-dessous :

| Fonds | Au 31 décembre 2022 | |
|---|--|----------------------------|
| | Émetteur de garantie | Juste valeur (en milliers) |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 20 983 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 836 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Gouvernement des États-Unis | 18 879 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | Gouvernement des États-Unis | 10 375 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 38 412 |
| Fonds Commodity Real Return Fund | Gouvernement des États-Unis | 61 286 |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 7 060 |
| Fonds Diversified Income Fund | Freddie Mac | 139 541 |
| | Ginnie Mae | 450 224 |
| | Gouvernement des États-Unis | 1 205 939 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Gouvernement des États-Unis | 104 889 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Freddie Mac | 139 541 |
| | Ginnie Mae | 413 154 |
| | Gouvernement des États-Unis | 621 400 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | € 100 270 |
| | Union européenne | 18 150 |
| | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 161 |
| | Landwirtschaftliche Rentenbank | 4 907 |
| | Gouvernement des États-Unis | 1 822 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 9 343 |

| Fonds | Au 31 décembre 2022 | | Fonds | Au 31 décembre 2022 | |
|---|--|----------------------------|--|-----------------------------|----------------------------|
| | Émetteur de garantie | Juste valeur (en milliers) | | Émetteur de garantie | Juste valeur (en milliers) |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 45 570 | Global Investment Grade Credit Fund | Gouvernement des États-Unis | 76 925 |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 8 567 | Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Gouvernement des États-Unis | 15 545 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Gouvernement des États-Unis | 720 | Fonds Global Low Duration Real Return Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 074 |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Gouvernement des États-Unis | 2 820 | Fonds Global Real Return Fund | Gouvernement des États-Unis | 2 391 |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | Gouvernement des États-Unis | 45 259 | Fonds Income Fund | Gouvernement des États-Unis | 3 498 550 |
| Fonds Euro Bond Fund | BNG Bank NV | € 11 063 | Fonds Inflation Multi-Asset Fund | Freddie Mac | 38 846 |
| | Gouvernement des États-Unis | 627 | | Gouvernement des États-Unis | 3 080 |
| Fonds Euro Credit Fund | BNG Bank NV | 2 776 | Fonds Low Average Duration Fund | Gouvernement des États-Unis | 975 |
| | Bpifrance SACA | 483 | Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 636 |
| | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | 568 | Fonds Low Duration Income Fund | Gouvernement des États-Unis | 101 947 |
| | Union européenne | 25 098 | Fonds Low Duration Opportunities Fund | Gouvernement des États-Unis | 121 176 |
| | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 4 431 | Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Gouvernement des États-Unis | 827 |
| | Landwirtschaftliche Rentenbank | 8 536 | Fonds Mortgage Opportunities Fund | Gouvernement des États-Unis | 17 694 |
| | État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie | 837 | Fonds StocksPLUS™ Fund | Gouvernement du Canada | 36 902 |
| | UNEDIC | 1 626 | | Gouvernement des États-Unis | 122 051 |
| | Gouvernement des États-Unis | 940 | Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 405 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | BNG Bank NV | 16 819 | Fonds Strategic Income Fund | Gouvernement des États-Unis | 797 |
| | État de Berlin | 102 209 | Fonds Total Return Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 174 491 |
| | Gouvernement des États-Unis | 3 935 | Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Gouvernement des États-Unis | 28 016 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 1 517 | Fonds UK Corporate Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | £ 181 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | BNG Bank NV | 14 286 | Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 274 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 3 743 | Fonds US High Yield Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 9 454 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 4 454 | Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 15 768 |
| Fonds Global Advantage Fund | Gouvernement des États-Unis | \$ 1 436 | Fonds US Short-Term Fund | Gouvernement des États-Unis | 157 561 |
| Fonds Global Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 378 007 | | | |
| Fonds Global Bond ESG Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 181 854 | | | |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | Gouvernement des États-Unis | 1 658 | | | |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Gouvernement des États-Unis | 11 642 | | | |

(iii) Données agrégées sur les opérations :

Les données agrégées sur les opérations correspondant aux positions de garantie (en numéraire notamment) reçues tous OTF et swaps de rendement total confondus au 31 décembre 2023 sont telles que suit :

| Fonds | Type de titre | Description de la garantie | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|---|------------------------------|--|------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|---|---------------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | \$ 3 933 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 630 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 257 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Contrats de mise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 9 824 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 3 064 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 7 724 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 6 850 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 5 779 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Morgan Stanley Obligations du Trésor américain | Secteur privé | 5 707 | A- | Plus d'un an | USD | États-Unis | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | | Trésor | 1 678 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 5 930 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Commodity Real Return Fund | Contrats de swap | Garantie en numéraire | Liquidités | 10 | S/O | S/O | USD | Australie | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 1 480 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 1 660 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 41 183 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 43 572 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 935 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 777 | AA+ | Plus d'un an | USD | Canada | FED, bilatéral |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | Type de titre | Description de la garantie | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|---|------------------------------|--|------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|---|---------------------------|
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | \$ 752 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Diversified Income Fund | Contrats de mise en pension | Obligation internationale du gouvernement canadien | Trésor | 84 905 | AA+ | Plus d'un an | CAD | Canada | CANADA, bilatéral |
| | | Province de l'Ontario | Trésor | 155 333 | AA- | 3 mois - 1 an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Province de l'Ontario | Trésor | 674 322 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Province du Québec | Trésor | 127 655 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 103 | AA+ | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 189 640 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 43 772 | AA- | Plus d'un an | GBP | France | CREST, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 2 346 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 35 656 | AAA | Plus d'un an | USD | Canada | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 33 005 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 399 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 3 067 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Contrats de mise en pension | Mortgage Pass Thru | | 104 | AA+ | Plus d'un an | USD | Royaume-Uni | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | Freddie Mac Obligations du Trésor américain | Trésor | 54 877 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 164 281 | AA+ | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 139 745 | AAA | Plus d'un an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 404 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 413 260 | AA- | Plus d'un an | GBP | France | CREST, bilatéral |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Contrats de swap | Garantie en numéraire | Liquidités | € 2 500 | S/O | S/O | EUR | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Obligation internationale du gouvernement belge | Trésor | 253 574 | AA- | Plus d'un an | EUR | France | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | Union européenne | Trésor | 72 014 | AAA | Plus d'un an | EUR | États-Unis | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 32 792 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | \$ 690 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 1 195 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | Contrats de mise en pension | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 15 987 | AA+ | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 651 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 580 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 2 801 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Obligations du Trésor américain | Trésor | 537 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 1 979 | AA+ | Plus d'un an | USD | Canada | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 1 712 | AA- | Plus d'un an | GBP | Royaume-Uni | CREST, bilatéral |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 13 986 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 690 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 5 606 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 301 | AA+ | Plus d'un an | USD | Canada | FED, bilatéral |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 013 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 6 400 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |

| Fonds | Type de titre | Description de la garantie | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|---|------------------------------|--|------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|---|---------------------------|
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | \$ 161 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 8 383 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Bond Fund | Contrats de mise en pension | État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie | Trésor | € 99 142 | AAA | Plus d'un an | EUR | Allemagne | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 327 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Credit Fund | Contrats de mise en pension | Obligation internationale du gouvernement belge | Trésor | 13 533 | AA- | Plus d'un an | EUR | France | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 752 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Income Bond Fund | Contrats de mise en pension | Land de Brandebourg | Trésor | 86 782 | AAA | Plus d'un an | EUR | Allemagne | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | Landesbank Baden-Wuerttemberg | Trésor | 57 106 | A- | Plus d'un an | EUR | Allemagne | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 4 156 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | Contrats de mise en pension | Bpifrance SACA | Secteur privé | 51 761 | AA- | Plus d'un an | EUR | France | EUROCLEAR, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 667 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 821 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Short-Term Fund | Contrats de mise en pension | Bpifrance SACA | Secteur privé | 12 736 | AA- | Plus d'un an | EUR | France | EUROCLEAR, bilatéral |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | Contrats de mise en pension | Obligation internationale du gouvernement belge | Trésor | 29 918 | AA- | Plus d'un an | EUR | France | EUROCLEAR, bilatéral |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Obligation internationale du gouvernement belge | Trésor | 987 | AA- | Plus d'un an | EUR | France | EUROCLEAR, bilatéral |
| Fonds Global Advantage Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | \$ 545 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Bond Fund | Contrats de mise en pension | Province d'Alberta | Trésor | 15 562 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Province de l'Ontario | Trésor | 84 805 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Province du Québec | Trésor | 61 993 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 77 604 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 95 180 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 45 099 | AA- | Plus d'un an | GBP | France | CREST, bilatéral |
| Fonds Global Bond ESG Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 169 340 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 025 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 250 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 316 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Contrats de mise en pension | Province de l'Ontario | Trésor | 151 161 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Province du Québec | Trésor | 8 415 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 25 972 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 260 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 326 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 947 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 3 735 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Real Return Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 936 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 3 304 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Obligations du Trésor américain | Trésor | 4 213 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 213 | AA- | 3 mois - 1 an | GBP | Royaume-Uni | CREST, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 238 | AA- | Plus d'un an | GBP | Royaume-Uni | CREST, bilatéral |
| Fonds Income Fund | Contrats de mise en pension | Province de l'Ontario | Trésor | 147 735 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Province du Québec | Trésor | 123 985 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 9 216 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | Type de titre | Description de la garantie | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|--|------------------------------|--|--------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|---|---------------------------|
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | Contrats de swap | Garantie en numéraire | Liquidités | \$ 480 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 1 080 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Low Average Duration Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 371 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 61 041 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 41 782 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 692 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Low Duration Income Fund | Contrats de mise en pension | Province d'Alberta | Trésor | 105 423 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Province de l'Ontario | Trésor | 54 325 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| | | Province du Québec | Trésor | 50 976 | AA- | Plus d'un an | CAD | États-Unis | CANADA, bilatéral |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 66 267 | AA+ | 3 mois - 1 an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 77 251 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 861 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 644 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 32 596 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 37 810 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Obligations du Trésor américain | Trésor | 1 837 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 58 670 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Ginnie Mae | Mortgage Pass Thru | 82 373 | AA+ | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Ginnie Mae | Mortgage Pass Thru | 52 981 | AA+ | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Contrats de swap | Freddie Mac | Mortgage Pass Thru | 40 217 | AA+ | Plus d'un an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Obligations du Trésor américain | Trésor | 71 637 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 20 093 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 292 821 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 30 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Strategic Income Fund | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 260 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 120 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Total Return Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 617 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 747 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 35 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 690 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Obligations du Trésor américain | Trésor | 17 608 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 291 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | £ 260 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 5 300 | AA- | Plus d'un an | GBP | Royaume-Uni | CREST, bilatéral |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | Contrats de prise en pension | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 483 | AA- | Plus d'un an | GBP | Royaume-Uni | CREST, bilatéral |
| | | Bons du Trésor britannique indexés sur l'inflation | Trésor | 6 625 | AA- | Plus d'un an | GBP | Royaume-Uni | CREST, bilatéral |
| Fonds US High Yield Bond Fund | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 251 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | \$ 930 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 264 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds US Short-Term Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 4 652 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |

Les données agrégées sur les opérations correspondant aux positions de garantie (en numéraire notamment) reçues tous OTF et swaps de rendement total confondus au 31 décembre 2022 sont telles que suit :

| Fonds | Type de titre | Description de la garantie | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|---|------------------------------|--|--------------------|----------------------------|---------------|-------------------------|-----------------------|---|---------------------------|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | \$ 20 983 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 836 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | Contrats de swap | Garantie en numéraire | Liquidités | 1 660 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 1 560 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | Garantie en numéraire | Liquidités | 590 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral | |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 11 461 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 7 418 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 3 516 | S/O | S/O | USD | Canada | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 6 877 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 264 | S/O | S/O | EUR | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | Garantie en numéraire | Liquidités | 7 614 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral | |
| Fonds Commodity Real Return Fund | Contrats de swap | Obligations du Trésor américain | Trésor | 38 412 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 840 | S/O | S/O | USD | Australie | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 1 310 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 625 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Diversified Income Fund | Contrats de mise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 60 504 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 592 195 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 277 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 2 481 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 102 408 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Freddie Mac | Mortgage Pass Thru | 139 541 | AAA | Plus d'un an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Dynamic Bond Fund | Contrats de mise en pension | Ginnie Mae | Mortgage Pass Thru | 450 224 | AAA | Plus d'un an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor américain | Trésor | 58 078 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | Bons du Trésor américain | Trésor | 42 150 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral | |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Contrats de swap | Obligations du Trésor américain | Trésor | 513 516 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 592 195 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | Trésor | 100 270 | AA | 3 mois - 1 an | EUR | France | FED, bilatéral |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Contrats de swap | Garantie en numéraire | Liquidités | € 10 200 | S/O | S/O | EUR | France | FED, bilatéral |
| | | Garantie en numéraire | Liquidités | 4 040 | S/O | S/O | EUR | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | Garantie en numéraire | Liquidités | 7 080 | S/O | S/O | EUR | États-Unis | FED, bilatéral | |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | Contrats de mise en pension | Mécanisme européen de stabilité | Trésor | 18 150 | AAA | De 1 à 3 mois | EUR | France | FED, bilatéral |
| | | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | Secteur privé | 161 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Bons du Trésor américain | Trésor | 1 822 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral | |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | Type de titre | Description de la garantie | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la Garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|---|------------------------------|--|------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|---|---------------------------|
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | \$ 9 343 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 2 609 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 9 446 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 36 124 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 807 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 2 332 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 6 235 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 720 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 549 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 271 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 45 259 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Bond Fund | Contrats de mise en pension | BNG Bank NV | Trésor | € 11 063 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 627 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Credit Fund | Contrats de mise en pension | BNG Bank NV | Trésor | 2 776 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Bpifrance SACA | Trésor | 483 | AA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | Trésor | 568 | AA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Banque de développement du Conseil de l'Europe | Trésor | 784 | AA+ | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Mécanisme européen de stabilité | Trésor | 4 996 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Banque européenne d'investissement | Trésor | 6 798 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Union européenne | Trésor | 12 520 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | Secteur privé | 979 | AAA | 3 mois - 1 an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | Secteur privé | 3 452 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Landwirtschaftliche Rentenbank | Secteur privé | 8 536 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie | Trésor | 837 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | UNEDIC | Trésor | 1 626 | AA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Income Bond Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 940 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | BNG Bank NV | Trésor | 16 819 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | Contrats de mise en pension | État de Berlin | Trésor | 102 209 | AAA | Plus d'un an | EUR | Allemagne | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 3 935 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Euro Short-Term Fund | Contrats de mise en pension | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | Secteur privé | 1 517 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | Contrats de mise en pension | BNG Bank NV | Trésor | 14 286 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | Secteur privé | 3 743 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | Secteur privé | 4 454 | AAA | Plus d'un an | EUR | France | FED, bilatéral |
| Fonds Global Advantage Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 1 436 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Bond Fund | Contrats de mise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 307 187 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 269 857 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 674 208 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 126 755 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |

| Fonds | Type de titre | Description de la garantie | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|--|--|--|--------------------|----------------------------|--------------|-------------------------|-----------------------|---|---------------------------|
| Fonds Global Bond ESG Fund | Contrats de mise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | \$ 320 650 | AAA | Plus d'un an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 36 147 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 281 796 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | Contrats de swap | Garantie en numéraire | Liquidités | 530 | S/O | S/O | USD | France | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 1 658 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 7 968 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 3 674 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 205 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 29 808 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Obligations du Trésor américain | Trésor | 31 422 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 15 695 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 15 545 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 1 074 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Global Real Return Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 290 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 101 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Income Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 404 498 | AAA | Jusqu'à 1 mois | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor américain | Trésor | 82 219 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Obligations du Trésor américain | Trésor | 9 894 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral | |
| | | Trésor | 747 747 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral | |
| | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation | Trésor | 323 152 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral | |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 257 998 | AAA | Plus d'un an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 673 042 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 273 | S/O | S/O | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | Contrats de swap | Garantie en numéraire | Liquidités | 240 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Freddie Mac | Mortgage Pass Thru | 38 846 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Billets du Trésor américain | | Trésor | 3 080 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral | |
| Fonds Low Average Duration Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 975 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 636 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Low Duration Income Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 5 540 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 96 407 | AAA | Plus d'un an | USD | Royaume-Uni | FED, bilatéral |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 121 176 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Contrats de swap | Garantie en numéraire | Liquidités | 370 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 827 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |

Notes relatives aux États financiers (suite)

| Fonds | Type de titre | Description de la garantie | Type de garantie | Juste valeur (en milliers) | Qualité | Échéance de la garantie | Devise de la garantie | Pays d'établissement de la contrepartie | Règlement et compensation |
|--|------------------------------|---------------------------------|------------------|----------------------------|---------|-------------------------|-----------------------|---|---------------------------|
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | \$ 3 690 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 14 004 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | Contrats de prise en pension | Garantie en numéraire | Liquidités | 4 656 | S/O | S/O | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | Contrats de mise en pension | Province de l'Ontario | Trésor | 36 902 | AA- | Plus d'un an | CAD | Canada | FED, bilatéral |
| | | Bons du Trésor américain | Trésor | 15 038 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Contrats de mise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 107 013 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 1 227 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| Fonds Strategic Income Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 797 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds Total Return Bond Fund | Contrats de mise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 26 800 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 5 911 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 141 780 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Contrats de mise en pension | Billets du Trésor américain | Trésor | 23 169 | AAA | Plus d'un an | USD | France | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 4 847 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | £ 181 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 274 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds US High Yield Bond Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | \$ 9 454 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | Contrats de mise en pension | Obligations du Trésor américain | Trésor | 13 133 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 2 635 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| Fonds US Short-Term Fund | Contrats de mise en pension | Bons du Trésor américain | Trésor | 2 725 | AAA | 3 mois - 1 an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |
| | | Billets du Trésor américain | Trésor | 154 836 | AAA | Plus d'un an | USD | États-Unis | FED, bilatéral |

La juste valeur de la garantie correspondant aux Contrats de mise en pension comprend les intérêts courus.

Les Contrats cadres de transactions à terme couvrent une combinaison d'opérations par achat et revente dos-à-dos, d'opérations par vente et rachat dos-à-dos et d'autres opérations de financement non incluses plus haut. Le montant total des garanties reçues au 31 décembre 2023 et au 31 décembre 2022 pour toutes les opérations effectuées dans le cadre de ces Contrats est indiqué plus haut. Il n'est pas possible d'analyser séparément la garantie correspondant à chaque OFT.

Les Contrats ISDA couvrent une combinaison d'accords de swap et le montant total des garanties pour ces contrats est indiqué ci-dessus.

Une partie des garanties indiquées se rapporte à des produits dérivés qui ne relèvent pas du champ de la ROFT.

(c) Rendement/Frais

Les tableaux qui suivent présentent en détail les données sur les rendements et les frais pour chaque type d'OFT et de swap de rendement total pour les exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022. Les montants sont présentés dans la devise de référence des Fonds.

| Fonds | 31 décembre 2023 | | | | | | | |
|---|-----------------------------|---------------------|------------------------------|---------------------|--|---------------------|---|---------------------|
| | Contrats de mise en pension | | Contrats de prise en pension | | Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos | | Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | |
| | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | \$ 1 159 | \$ 0 | \$ 0 | \$ (223) | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 72 | 0 | 0 | (3) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 858 | 0 | 2 | (30) | 0 | 0 | 0 | (32) |

| Fonds | 31 décembre 2023 | | | | | | | |
|--|-----------------------------|---------------------|------------------------------|---------------------|--|---------------------|---|---------------------|
| | Contrats de mise en pension | | Contrats de prise en pension | | Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos | | Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | |
| | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | \$ 2 849 | \$ 0 | \$ 676 | \$ (16 412) | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | 1 367 | 0 | 0 | (7) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Commodity Real Return Fund | 449 | 0 | 0 | (18 205) | 0 | (2) | 0 | (359) |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 324 | 0 | 0 | (35) | 0 | 0 | 0 | (10) |
| Fonds Diversified Income Fund | 60 918 | 0 | 59 | (1 014) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | 4 181 | 0 | 0 | (17) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | 185 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | 36 282 | (2) | 0 | (12) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | € 9 647 | € 0 | € 0 | € (52) | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | \$ 681 | \$ 0 | \$ 70 | \$ (11 198) | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | 52 | 0 | 0 | (28) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 144 | 0 | 0 | (6 008) | 0 | 0 | 0 | (256) |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | 3 526 | 0 | 0 | (2 525) | 0 | (51) | 0 | (141) |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | 81 | 0 | 0 | (3) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 206 | 0 | 0 | (229) | 0 | 0 | 0 | (73) |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 158 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | 1 550 | 0 | 0 | (256) | 0 | 0 | 0 | (5) |
| Fonds Euro Bond Fund | € 1 830 | € (87) | € 14 | € (17) | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Fonds Euro Credit Fund | 708 | 0 | 0 | (65) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | 3 607 | 0 | 7 | (97) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | 376 | 0 | 0 | (165) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | 377 | 0 | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | 630 | 0 | 0 | (23) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 74 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Global Advantage Fund | \$ 41 | \$ 0 | \$ 0 | \$ (353) | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ (58) |
| Fonds Global Bond Fund | 30 277 | (90) | 64 | (1) | 0 | 0 | 0 | (20) |
| Fonds Global Bond ESG Fund | 14 597 | 0 | 0 | (28) | 0 | 0 | 0 | (21) |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | 50 | 0 | 0 | (8) | 0 | 0 | 0 | (3) |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 332 | 0 | 52 | (402) | 0 | 0 | 0 | (13) |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 26 901 | (37) | 0 | (81) | 0 | 0 | 0 | (8) |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | 422 | 0 | 0 | (5 682) | 0 | (3) | 0 | (1 119) |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 56 | 0 | 0 | (22 301) | 0 | 0 | 0 | (874) |
| Fonds Global Real Return Fund | 74 | (2 448) | 0 | (42 618) | 0 | 0 | 0 | (457) |
| Fonds Income Fund | 177 779 | 0 | 5 | (387) | 0 | 0 | 0 | (682) |
| Fonds Income Fund II | 0 | (51) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (23) |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | 426 | 0 | 0 | (220) | 0 | 0 | 0 | (22) |
| Fonds Low Average Duration Fund | 0 | (1 316) | 0 | (5 703) | 0 | (1) | 0 | (2 284) |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 63 | 0 | 0 | (866) | 0 | 0 | 0 | (492) |
| Fonds Low Duration Income Fund | 11 266 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 2 437 | 0 | 0 | (221) | 23 | 0 | 0 | (103) |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | 6 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 20 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | 1 295 | 0 | 0 | (12 150) | 0 | 0 | 0 | (10) |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | 24 579 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 130 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Strategic Income Fund | 31 | 0 | 0 | (352) | 0 | 0 | 0 | (82) |
| Fonds Total Return Bond Fund | 440 | 0 | 0 | (409) | 0 | 0 | 0 | (140) |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 564 | 0 | 0 | (11) | 0 | 0 | 0 | (28) |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | £ 227 | £ 0 | £ 0 | £ (856) | £ 0 | £ 0 | £ 0 | £ 0 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | 114 | 0 | 0 | (171) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | \$ 338 | \$ 0 | \$ 29 | \$ (134) | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ (22) |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | 512 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 |
| Fonds US Short-Term Fund | 2 743 | 0 | 0 | (4) | 0 | (16) | 0 | (297) |

Notes relatives aux États financiers (suite)

31 décembre 2022

| Fonds | Contrats de mise en pension | | Contrats de prise en pension | | Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos | | Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos | |
|--|-----------------------------|---------------------|------------------------------|---------------------|--|---------------------|---|---------------------|
| | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) | Rendement (en milliers) | Frais (en milliers) |
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | \$ 1 057 | \$ 0 | \$ 818 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 33 | 0 | 29 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 144 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | 195 | 0 | 401 | (9 618) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | 271 | 0 | 0 | (4) | 0 | 0 | 0 | (1) |
| Fonds Commodity Real Return Fund | 327 | 0 | 0 | (4 073) | 0 | (105) | 0 | (1 859) |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 127 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Diversified Income Fund | 15 705 | 0 | 3 046 | (7) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | 1 358 | 0 | 60 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Dynamic Bond Fund | 8 310 | 0 | 43 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | € 148 | € 0 | € 0 | € (6) | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | \$ 141 | \$ (91) | \$ 0 | \$ (6 016) | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 240 | 0 | 0 | (994) | 0 | 0 | 0 | (87) |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | 888 | 0 | 137 | (245) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | 33 | 0 | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 324 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 12 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | 514 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Euro Bond Fund | € 9 | € (36) | € 14 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Fonds Euro Credit Fund | 56 | 0 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Euro Income Bond Fund | 13 | (5) | 44 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Euro Short-Term Fund | 0 | (41) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | 0 | (15) | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 0 | (29) | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Global Advantage Fund | \$ 7 | \$ 0 | \$ 130 | \$ (189) | \$ 0 | \$ 0 | \$ 0 | \$ (59) |
| Fonds Global Bond Fund | 9 293 | 0 | 2 787 | (1 200) | 0 | 0 | 0 | (31) |
| Fonds Global Bond ESG Fund | 6 766 | 0 | 0 | (8) | 0 | 0 | 0 | (1) |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | 9 | 0 | 313 | (50) | 0 | 0 | 0 | (12) |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 1 677 | 0 | 387 | (93) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 325 | 0 | 0 | (70) | 0 | 0 | 0 | (7) |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | 90 | 0 | 0 | (830) | 0 | 0 | 0 | (234) |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 28 | 0 | 0 | (431) | 0 | (3) | 0 | (3 169) |
| Fonds Global Real Return Fund | 108 | 0 | 58 | (12 072) | 0 | 0 | 0 | (272) |
| Fonds Income Fund | 93 412 | (70) | 1 457 | 0 | 0 | 0 | 0 | (89) |
| Fonds Income Fund II | 14 | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | 1 101 | 0 | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 | (2) |
| Fonds Low Average Duration Fund | 448 | 0 | 0 | (959) | 0 | 0 | 0 | (199) |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 13 | 0 | 0 | (150) | 0 | 0 | 0 | (45) |
| Fonds Low Duration Income Fund | 1 256 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 2 501 | 0 | 8 | (102) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 10 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | 126 | 0 | 0 | (6 518) | 0 | 0 | 0 | (7) |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | 2 323 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 26 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds Strategic Income Fund | 7 | 0 | 0 | (6) | 0 | 0 | 0 | (1) |
| Fonds Total Return Bond Fund | 3 214 | 0 | 20 | (353) | 0 | 0 | 0 | (22) |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 174 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | £ 145 | £ 0 | £ 0 | £ (195) | £ 0 | £ 0 | £ 0 | £ 0 |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | 30 | 0 | 0 | (86) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Fonds US High Yield Bond Fund | \$ 1 076 | \$ 0 | \$ 29 | \$ (58) | \$ 0 | \$ 0 | \$ 1 | \$ 0 |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | 45 | 0 | 0 | (8) | 0 | 0 | 0 | (9) |
| Fonds US Short-Term Fund | 1 315 | 0 | 0 | (683) | 0 | 0 | 0 | (391) |

Tous les rendements des opérations sur instruments financiers dérivés OFT sont acquis au Fonds et ne font l'objet d'aucun accord de partage des rendements avec le Gestionnaire de la Société ni aucun autre tiers.

En ce qui concerne les swaps de rendement total, les frais de transaction ne peuvent être identifiés séparément. Pour ces investissements, les frais de transaction sont inclus dans le prix d'achat et de vente et font partie de la performance d'investissement brut de chaque Fonds. Les rendements sont identifiés comme les plus-values réalisées et la variation des plus-values latentes sur le contrat de swap au cours de l'exercice, qui sont incluses dans la Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés et la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés au Compte de résultat.

23. ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS

Depuis février 2022, un conflit armé est en cours entre la Russie et l'Ukraine, entraînant des sanctions imposées à diverses entités et personnes russes. Depuis octobre 2023, un conflit armé en Israël et à Gaza est également en cours et depuis avril 2024, l'Iran et Israël ont lancé des offensives militaires l'un contre l'autre dans une situation qui évolue rapidement. Les Fonds peuvent investir dans des titres et instruments qui sont économiquement liés à ces zones de conflits. Ces investissements peuvent avoir été affectés négativement par les éventuelles sanctions et contresanctions, engendrant notamment une baisse de valeur et de liquidité. La réduction de la liquidité des investissements peut obliger les Fonds à vendre des participations en portefeuille à un moment ou à un prix désavantageux ou à continuer à détenir des investissements que les Fonds pourraient ne plus vouloir détenir. PIMCO continuera à gérer activement ces positions dans le meilleur intérêt des Fonds et de leurs actionnaires.

Le 1^{er} janvier 2023, l'abandon de Frais de gestion pour le Fonds Income Fund II a expiré. À la même date, l'abandon de Frais de gestion pour le Fonds Low Duration Income Fund a expiré et les Frais de gestion ont été abaissés de manière permanente.

Le 3 janvier 2023, les abandons de Frais de gestion applicables aux Fonds Low Duration Income Fund et Income Fund II ont été modifiés.

Le 18 janvier 2023, les abandons de Frais de gestion applicables aux Fonds Euro Short-Term Fund et PIMCO European Short-Term Opportunities Fund ont été modifiés.

Le 26 janvier 2023, la fonction de Secrétaire de la Société est passée de State Street Fund Services (Ireland) Limited à Walkers Corporate Services (Ireland) Limited.

Le 6 avril 2023, une souscription de 5 000 000 USD a été effectuée par le Gestionnaire sur le Fonds US Short-Term Fund.

Le 26 avril 2023, un rachat de 11 580 279 USD a été effectué par le Gestionnaire sur le Fonds US Short-Term Fund.

Le 1^{er} juin 2023, l'abandon de Frais de gestion applicable à la Catégorie Investisseurs de capitalisation du Fonds PIMCO Climate Bond Fund a expiré.

Le 30 juin 2023, le Supplément du Fonds Euro Credit Fund a été mis à jour afin de prolonger d'un an l'abandon de Frais de gestion de 25 points de base de la Catégorie H Institutions, jusqu'au 30 juin 2024.

Le 18 août 2023, l'accord de facilité de crédit conclu par PIMCO Funds : Global Investors Series plc agissant pour le compte des Fonds Global High Yield Bond Fund et US High Yield Bond Fund avec certains prêteurs, dont MUFG Bank Ltd. (« MUFG ») a été modifié et étendu au Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund.

Le 1^{er} septembre 2023, l'indice de référence du Fonds Euro Short-Term Fund a été remplacé par l'Indice ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index.

Le 29 novembre 2023, le Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund a été renommé Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund après approbation réglementaire. Outre le changement de nom et comme notifié aux actionnaires, le Supplément a été mis à jour pour refléter certaines modifications non significatives apportées à la politique d'investissement.

Aucun autre événement important ne s'est produit au cours de l'exercice en dehors de ceux susmentionnés.

24. ÉVÉNEMENTS POSTÉRIEURS

Le 2 janvier 2024, les frais de gestion du Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund ont été mis à jour de la manière suivante : les frais de commission unifiés facturés pour toutes les catégories d'actions du Fonds sont réduits de 25 pb, à l'exception des catégories R et T, dont les frais de gestion sont respectivement abaissés de 14 pb et 15 pb.

Le 10 janvier 2024, les abandons de Frais de gestion applicables aux catégories d'actions concernées des Fonds Euro Short-Term Fund et PIMCO European Short-Term Opportunities Fund ont été prolongées jusqu'au 18 janvier 2025 et

17 janvier 2025, respectivement. À la même date, un Supplément modifié a été émis pour le Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund.

Le 1^{er} février 2024, les frais de gestion du Fonds Emerging Markets Bond Fund ont été mis à jour de la manière suivante : les frais de commission unifiés facturés au titre des catégories d'actions institutionnelles du Fonds sont réduits de 7 pb, et ils sont réduits au prorata pour toutes les catégories d'actions restantes du Fonds qui sont concernées.

Le 6 février 2024, nous avons été profondément attristés d'apprendre le décès de John Bruton, Administrateur de la Société et Gestionnaire.

Le 21 mars 2024, le Prospectus a été mis à jour pour intégrer certaines modifications non essentielles, y compris, mais sans s'y limiter : mise à jour des facteurs de risque, clarifications concernant les publications relatives aux principales incidences négatives, améliorations apportées aux publications générales sur les investissements ESG, mise à jour de la section fiscalité, mise à jour des biographies des Administrateurs, modifications des dispositions relatives à la lutte contre le blanchiment d'argent et ajout d'informations sur les obligations liées à des événements pour certains suppléments de Fonds, qui ont également été mis à jour à la même date.

Le 8 avril 2024, le Supplément du Fonds PIMCO Climate Bond Fund a été mis à jour pour faire correspondre la stratégie d'exclusion du Fonds avec la Politique d'exclusion en matière de durabilité de PGAIL, qui a été mise à disposition sur le site Internet de PGAIL, et pour clarifier les informations existantes relatives à l'engagement des émetteurs. En outre, l'Annexe au Supplément du Fonds a également été mise à jour pour refléter ces modifications et intégrer certaines modifications non essentielles, y compris : clarifications concernant l'objectif d'investissement durable du Fonds, mise à jour des indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de l'objectif d'investissement durable du Fonds, améliorations visant à clarifier la manière dont les investissements durables du Fonds sont évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à l'objectif d'investissement durable du Fonds ; et pour confirmer que les investissements du Fonds n'incluent pas d'activités liées au gaz et au nucléaire dans le cadre de la taxinomie.

À la même date, le Supplément du Fonds Low Duration Income Fund a été mis à jour afin d'augmenter l'exposition maximale autorisée du Fonds à des investissements non libellés en USD, qui est passée de 10 % à 15 % de l'actif total.

Aucun autre événement important n'a eu lieu après la clôture de l'exercice en dehors de ceux susmentionnés.

25. APPROBATION DES ÉTATS FINANCIERS

Les états financiers ont été approuvés le 25 avril 2024 par le Conseil d'administration.

Rapport des Administrateurs

Les Administrateurs présentent aux actionnaires les états financiers audités de la Société pour l'exercice clos le 31 décembre 2023.

RESPONSABILITÉS DES ADMINISTRATEURS

Les Administrateurs sont chargés de préparer le rapport annuel et les états financiers dans le respect du droit irlandais applicable et des Principes comptables généralement admis en Irlande, notamment de la norme Financial Reporting Standard 102 (« FRS 102 »), « La norme de présentation de l'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » émise par le Financial Reporting Council, de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et de la Réglementation sur les OPCVM.

Dans le droit irlandais, les Administrateurs ne doivent approuver les états financiers que s'ils ont établi à leur satisfaction que ceux-ci donnent une idée exacte et fidèle des actifs et passifs de la Société et de sa situation financière à la fin de l'exercice, ainsi que du bénéfice ou de la perte de la Société pour l'exercice.

En préparant les états financiers, les Administrateurs sont tenus de :

- sélectionner des méthodes comptables adaptées et les appliquer de manière systématique ;
- apporter des jugements et estimations qui soient raisonnables et prudents ;
- indiquer si les états financiers ont été préparés conformément aux normes comptables applicables et identifier les normes en question, sous réserve que toute divergence importante avec ces normes soit décrite et expliquée dans les notes relatives aux états financiers ; et
- établir les états financiers en appliquant le principe de continuité d'exploitation, à moins qu'il soit inapproprié de présumer que la Société poursuivra ses activités.

Les Administrateurs sont responsables de la tenue d'archives comptables adéquates et suffisantes pour :

- enregistrer et expliquer correctement les transactions de la Société ;
- permettre, à tout moment, de déterminer avec une exactitude raisonnable les actifs, les passifs, la situation financière, le bénéfice ou la perte de la Société ; et
- permettre aux Administrateurs de s'assurer que les états financiers respectent la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et permettre l'audit de ces états financiers.

Ils sont également chargés d'assurer la protection des actifs de la Société, et donc de prendre les mesures nécessaires raisonnables pour la prévention et la détection des fraudes et autres irrégularités.

Les Administrateurs sont chargés du maintien et de l'intégrité de l'information sociale et financière figurant sur le site de la Société. La législation irlandaise en matière de préparation et de diffusion d'états financiers peut différer de celle d'autres juridictions.

DÉCLARATION DE CONFORMITÉ DES ADMINISTRATEURS

La Société a pour politique de respecter ses obligations pertinentes (telles que définies dans la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014). Comme l'exige l'Article 225(2) de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, les Administrateurs reconnaissent qu'il leur incombe de faire en sorte que la Société se conforme aux obligations pertinentes. Les Administrateurs ont rédigé une déclaration de politique de conformité, telle que définie à l'Article 225(3)(a) de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, et une politique de conformité qui fait référence aux arrangements et structures en place qui, selon l'opinion des Administrateurs, sont conçus pour garantir le respect des obligations pertinentes de la Société, et ils ont procédé au cours de cet exercice à un examen des arrangements ou structures mis en place. Dans le cadre de l'exécution de leurs responsabilités en vertu de l'Article 225, les Administrateurs se sont fondés, entre autres, sur les services, conseils et/ou déclarations de tiers dont les Administrateurs croient qu'ils disposent des connaissances et de l'expérience requises pour garantir le respect des obligations pertinentes de la Société.

EMPLOYÉS

La Société n'avait aucun employé au cours des exercices clos le 31 décembre 2023 et le 31 décembre 2022.

DÉCLARATION RELATIVE AUX INFORMATIONS D'AUDIT PERTINENTES

Les Administrateurs en fonction à la date du présent rapport ont confirmé, chacun, ce qui suit :

- à sa connaissance, il n'existe aucune information d'audit pertinente dont le commissaire aux comptes de la Société n'ait pas connaissance ; et

- il/elle a pris toutes les mesures qu'il/elle devait prendre, en sa qualité d'administrateur, pour s'informer de toute information d'audit pertinente et pour s'assurer que le commissaire aux comptes de la Société a connaissance de ces informations.

RÉSULTATS, ACTIVITÉS ET DÉVELOPPEMENTS ULTÉRIEURS

Les résultats des opérations et les dividendes déclarés sont exposés dans le Compte de résultat aux pages 92 à 111. On trouvera un rapport sur le rendement des placements du Fonds et un aperçu du portefeuille sur les pages 6 à 66.

PRINCIPAUX RISQUES ET INCERTITUDES

Les détails relatifs aux objectifs et politiques de la gestion des risques financiers de la Société, et l'exposition de la Société aux risques du cours du marché, de change, de taux d'intérêt, de liquidité, de crédit et de contrepartie, sont divulgués dans la note 16 des Notes relatives aux États financiers.

ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS

Une liste des événements importants touchant la Société au cours de l'exercice est divulguée à la Note 23.

ÉVÉNEMENTS POSTÉRIEURS À LA DATE DE CLÔTURE DU BILAN

La Note 24 présente la liste des événements survenus après la date de clôture du bilan qui concernent la Société après la fin de l'exercice.

REGISTRES COMPTABLES

Les mesures prises par les Administrateurs pour garantir le respect par la Société de ses obligations de tenir des registres comptables adéquats consistent en l'utilisation de systèmes et procédures adéquats, et au recrutement de personnes compétentes. Les registres comptables sont tenus au niveau de State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin, D02 HD32, Irlande.

DÉCLARATION RELATIVE À LA GOUVERNANCE D'ENTREPRISE

La Société est soumise et se conforme à la législation irlandaise, qui comprend la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, à la Réglementation des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2011 (S.I. N° 352 de 2011), tel que modifié (la « Réglementation sur les OPCVM »), ainsi qu'aux Règles de cotation du Global Exchange Market (« GEM ») d'Euronext Dublin telles qu'elles s'appliquent aux Fonds de placement. Le Conseil d'administration (le « Conseil ») a évalué les mesures incluses dans le Code de gouvernance des Organismes de placement collectif et des Sociétés de gestion, dont l'application est volontaire, tel que publié par l'Irish Fund Industry Association en décembre 2011 (le « Code IFIA »). Le Conseil a adopté toutes les pratiques et procédures de gouvernance d'entreprise prévues par le Code IFIA.

Le Conseil a estimé que les mesures comprises dans le code IFIA étaient cohérentes avec ses pratiques et procédures de gouvernance d'entreprise pour l'exercice. Chaque prestataire de services auquel fait appel la Société est soumis à ses propres obligations en matière de gouvernance d'entreprise.

Processus de communication financière – description des principales caractéristiques

Le Conseil est chargé d'établir et de maintenir le contrôle interne approprié et les systèmes de gestion des risques de la Société dans le cadre du processus de communication financière. Ces systèmes sont destinés à gérer plutôt qu'à éliminer le risque de ne pas atteindre les objectifs de communication financière de la Société. Ils ne peuvent donner qu'une assurance raisonnable et non absolue contre les erreurs et les pertes significatives.

Le Conseil a défini des procédures afférentes au contrôle interne et aux systèmes de gestion des risques pour assurer sa supervision réelle du processus de communication financière. Ces procédures comprennent la nomination d'un Agent administratif, State Street Fund Administration Services (Ireland) Limited, pour la tenue des livres et des registres. L'Agent administratif est agréé et régi par la Banque centrale et doit respecter les règles imposées par cette dernière. L'Agent administratif est contractuellement tenu de préparer le rapport annuel comprenant les états financiers destinés à donner une image sincère et fidèle et les rapports semestriels et de les soumettre à l'examen et à l'approbation du Conseil.

Le Conseil évalue et étudie les questions importantes d'ordre comptable et relatives à la communication, si besoin est. Le Conseil examine et évalue périodiquement les procédures de comptabilité et de communication de l'Agent administratif, ainsi que la performance, les qualifications et l'indépendance des Commissaires aux comptes externes. La responsabilité de l'Agent administratif

est de nature opérationnelle en ce qui concerne ses contrôles internes du processus de communication financière et le rapport de l'Agent administratif au Conseil.

Évaluation du risque

Le Conseil a la responsabilité d'évaluer le risque d'irrégularités, d'origine frauduleuse ou émanant d'une erreur, dans la communication financière et de veiller à ce que les procédures soient en place pour l'identification en temps voulu des questions internes et externes susceptibles d'avoir un effet important sur la communication financière. Le Conseil a également mis en place des procédures visant à identifier les changements des principes et des recommandations comptables et à garantir que ces changements apparaissent correctement dans les états financiers de la Société.

Activités de contrôle

L'Agent administratif veille au maintien des structures de contrôle de gestion du risque sur la communication financière. Ces structures de contrôle consistent à répartir les responsabilités et à exécuter des activités spécifiques de contrôle visant à détecter ou à éviter le risque de lacune importante dans la communication financière en ce qui concerne les postes importants des états financiers et les notes annexes du rapport annuel de la Société. Les activités de contrôle exercées par l'Agent administratif comprennent par exemple des procédures d'étude analytiques et des réconciliations et contrôles automatisés des systèmes informatiques. La méthode de valorisation des titres et autres actifs lorsque les prix ne sont pas disponibles auprès d'une source extérieure indépendante est divulguée à la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

Information et communication

Les politiques de la Société et les instructions du Conseil afférentes à la communication financière sont actualisées et diffusées via les canaux appropriés, comme les messages électroniques, la correspondance et les réunions pour veiller à ce que toutes les obligations en matière d'information financière soient satisfaites avec exhaustivité et précision.

Suivi

Le Conseil reçoit régulièrement des présentations et étudie les rapports du Dépositaire, des Conseillers en investissement et de l'Agent administratif. Le Conseil applique également un processus annuel permettant de s'assurer que des mesures adéquates sont prises afin de tenir compte et de résoudre les défauts identifiés et les mesures recommandées par les commissaires aux comptes indépendants.

Structure du capital

Personne ne détient, directement ou indirectement, un volume substantiel de titres de la Société. Personne ne dispose de droits particuliers de contrôle sur le capital social de la Société.

Les droits de vote ne font l'objet d'aucune restriction.

Pouvoirs des Administrateurs

En ce qui concerne la nomination et le remplacement des Administrateurs, la Société est régie par ses Statuts, les lois irlandaises comprenant la Loi sur les sociétés (Companies Acts) de 2014, la Réglementation sur les OPCVM, ainsi que les Règles de cotation du GEM d'Euronext Dublin applicables aux Fonds de placement. Les Statuts peuvent être modifiés sur résolution extraordinaire des actionnaires.

Le Conseil est responsable de la gestion des affaires de la Société conformément aux Statuts. Les Administrateurs peuvent déléguer certaines fonctions à l'Agent administratif et autres parties, sous la supervision et les directives des Administrateurs. Les Administrateurs ont délégué l'administration quotidienne de la Société à l'Agent administratif et les fonctions de gestion des investissements et de distribution aux Conseillers en investissement. Il en résulte qu'aucun Administrateur n'est exécutif.

Les Statuts stipulent que les Administrateurs peuvent exercer tous les pouvoirs de la Société pour emprunter de l'argent, hypothéquer ou nantir, tout ou partie de son entreprise et de ses biens immobiliers. Ils peuvent également déléguer ces pouvoirs aux Conseillers en investissement.

Les Administrateurs peuvent, à tout moment et périodiquement, suspendre à titre provisoire le calcul de la Valeur Nette d'Inventaire d'un Fonds particulier, ainsi que l'émission, le rachat et la conversion des actions dans un des cas suivants :

(a) pendant une période où un marché ou une Bourse de valeurs reconnue qui est le principal marché ou la principale Bourse de valeurs reconnue pour une part substantielle des investissements du Fonds est fermé (autre que pendant les jours fériés normaux ou pour la fermeture habituelle du week-end), ou pendant laquelle la négociation est limitée ou suspendue sur ce marché ou cette Bourse de valeurs ;

(b) pendant une période où survient un cas d'urgence qui a pour conséquence que la cession d'investissements qui représentent une part substantielle des actifs de la catégorie concernée par la Société n'est pas faisable ; ou pendant laquelle il est impossible de transférer des fonds pour acheter ou vendre des investissements à des taux de change normaux ; ou pendant laquelle il est impossible aux Administrateurs ou à leur délégué de déterminer correctement la valeur d'un actif du Fonds concerné ;

(c) pendant une interruption des moyens de communication qui servent habituellement à déterminer le prix de tout investissement du Fonds concerné ou les prix réels sur un marché ou une Bourse de valeurs reconnue ;

(d) si, pour une raison quelconque, les prix d'investissements d'une catégorie concernée ne peuvent être raisonnablement, rapidement ou précisément déterminés ;

(e) pendant une période où le versement de fonds qui seraient ou pourraient être impliqués dans la réalisation ou le paiement d'investissements d'une catégorie concernée ne peut, selon les Administrateurs, être effectué à des taux de change normaux ;

(f) pour liquider la Société ou clôturer un Fonds ; ou

(g) pour toute autre raison qui rend impossible la détermination correcte par leur délégué de la valeur d'une part substantielle des investissements de la Société ou d'un Fonds.

Un avis faisant part de cette suspension et un avis annonçant la fin de la suspension sera adressé immédiatement à la Banque centrale et à Euronext Dublin et les souscripteurs d'Actions ou les actionnaires qui demandent le rachat d'Actions seront informés au moment où ils déposent leur demande écrite de souscription ou de rachat. Toutes les mesures raisonnables seront prises, lorsque c'est possible, pour mettre fin à une période de suspension le plus rapidement possible.

Il est possible de transférer les actions nominatives sur demande écrite. Le document de transfert doit être accompagné d'un certificat du cessionnaire précisant qu'il n'achète pas les Actions pour le compte ou au bénéfice d'un Ressortissant des États-Unis. En cas de décès de l'un des codétenteurs, le ou les survivant(s) sera/seront la/les seule(s) personne(s) à laquelle/auxquelles l'Agent administratif reconnaît un droit de propriété sur ou un intérêt dans les Actions enregistrées aux noms de ces co-Actionnaires. Les Administrateurs peuvent refuser d'enregistrer un transfert s'ils savent ou pensent raisonnablement que, du fait de ce transfert, les Actions seraient la propriété réelle d'une personne en violation des limites imposées à la propriété par les Administrateurs ou que ce transfert aurait un effet juridique, réglementaire, pécuniaire, fiscal ou administratif défavorable important pour le Fonds concerné ou les actionnaires de manière générale.

Assemblées des actionnaires

L'Assemblée générale annuelle de la Société se tiendra normalement à Dublin, en septembre ou à toute autre date que les Administrateurs peuvent déterminer. L'avis de convocation à l'Assemblée générale annuelle au cours de laquelle les états financiers audités de la Société sont présentés (avec le rapport des Administrateurs et celui des Commissaires aux comptes de la Société) est adressé aux actionnaires à leur adresse inscrite au moins 21 jours francs avant la date fixée pour l'assemblée. D'autres assemblées générales peuvent être convoquées périodiquement par les Administrateurs selon la manière stipulée par le droit irlandais.

Chaque action donne droit à son détenteur à assister et à voter aux assemblées de la Société et du Fonds représenté par ces actions. Les questions peuvent être déterminées par une assemblée des actionnaires par un vote à main levée, sauf si un scrutin est requis par un actionnaire ayant le droit de vote à l'assemblée ou si le président de l'assemblée demande un scrutin. Chaque actionnaire dispose d'une voix lors d'un vote à main levée. Chaque action donne droit à son détenteur à une voix pour les sujets afférents à la Société qui sont soumis aux actionnaires par un scrutin.

Aucune catégorie d'actions ne confère à un détenteur de droits préférentiels ou de préemption ou de droits à participer aux bénéfices et aux dividendes d'une autre catégorie d'actions ou de droits de vote sur des sujets concernant uniquement une autre catégorie d'actions.

Une résolution visant à modifier les droits d'une catégorie nécessite l'approbation des trois quarts des détenteurs des actions représentées ou présentes et votant

à une assemblée générale de la catégorie. Le quorum d'une assemblée générale de la catégorie convoquée pour statuer sur une modification des droits de la catégorie est de deux actionnaires au moins dont les détentions représentent un tiers des actions.

Chaque action, à l'exception des actions de souscripteur, donne le droit à son porteur de participer également au prorata aux dividendes et aux actifs nets du Fonds pour lequel les actions ont été émises, sauf dans le cas des dividendes déclarés avant qu'il ne devienne actionnaire.

Les actions de souscripteur donnent droit aux actionnaires qui les détiennent d'assister et de voter aux assemblées générales de la Société mais ne leur donnent pas le droit de participer aux dividendes ou à l'actif net de la Société.

Composition et fonctionnement du Conseil et des Comités

Le Conseil se compose actuellement de cinq Administrateurs, tous non exécutifs, dont deux d'entre eux sont indépendants des Conseillers en investissement. Les actionnaires peuvent démettre les Administrateurs sur simple résolution ordinaire, conformément aux procédures établies en vertu de la Loi irlandaise sur les sociétés (Companies Act) de 2014. Le Conseil se réunit au moins une fois par trimestre pendant chaque année civile. Le Conseil comporte un comité d'audit composé actuellement des deux Administrateurs indépendants qui se sont réunis quatre fois pendant l'exercice considéré.

OPÉRATIONS AVEC DES PERSONNES LIÉES

Les transactions effectuées avec le Gestionnaire ou le dépositaire d'un OPCVM et leurs délégués ou sous-délégués (à l'exclusion de tout sous-dépositaire désigné par un dépositaire et qui n'est pas une société du groupe) et toute entité associée ou société appartenant au même groupe que ce Gestionnaire, dépositaire, délégué ou sous-délégué (« personnes liées ») doivent être effectuées comme si elles étaient réalisées dans des conditions commerciales normales, négociées dans des conditions de pleine concurrence et seulement lorsqu'elles sont dans l'intérêt des actionnaires. Les Administrateurs sont convaincus que des arrangements (comme en font foi les procédures écrites) sont en place pour garantir que les opérations avec des personnes liées sont effectuées comme décrit plus haut et que les conditions y afférentes ont été respectées au cours de l'exercice.

ADMINISTRATEURS

Les Administrateurs qui étaient en fonction pendant l'exercice clos au 31 décembre 2023 sont :

V. Mangala Ananthanarayanan – nommée le 30 juin 2016
Ryan P. Blute – nommé le 30 mai 2014
John Bruton – nommé le 28 février 2018
Craig A. Dawson – nommé le 6 mai 2009
David M. Kennedy – nommé le 16 avril 1999
Frances Ruane – nommée le 28 février 2018

Les Statuts ne prévoient pas de retrait des Administrateurs par rotation.

SECRÉTAIRE

Walkers Corporate Services (Ireland) Limited a exercé les fonctions de Secrétaire pour l'exercice clos le 31 décembre 2023.

INTÉRÊTS DES ADMINISTRATEURS ET DU SECRÉTAIRE EN ACTIONS ET CONTRATS

Au 31 décembre 2023, V. Mangala Ananthanarayanan détenait 8 187,77 (31 décembre 2022 : 8 187,77) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5 319,15 (31 décembre 2022 : 5 319,15) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 0 (31 décembre 2022 : 8 757,87) actions du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, 3 619,69 (31 décembre 2022 : 3 619,69) actions du Fonds Global Bond Fund et 27 543,65 (31 décembre 2022 : 27 543,65) actions du Fonds Income Fund, tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2023, Ryan P. Blute détenait 0 (31 décembre 2022 : 5 387,93) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 28 827,68 (31 décembre 2022 : 24 131,27) actions du Fonds Low Average Duration Fund et 50 751,14 (31 décembre 2022 : 82 494,63) actions du Fonds Low Duration Income Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2023, Craig A. Dawson détenait 18 118,23 (31 décembre 2022 : 18 118,23) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 97 370,98 (31 décembre 2022 : 97 370,98) actions du Fonds Low Duration Income Fund et 92 850,51 (31 décembre 2022 : 92 850,51) actions du Fonds Low Duration Opportunities Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2023, David M. Kennedy détenait 4 186,59 (31 décembre 2022 : 4 449,56) actions du Fonds Emerging Markets Bond Fund et 16 786,79 (31 décembre 2022 : 16 786,79) actions du Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund, tous deux Fonds de la Société.

Le Secrétaire ne détenait pas d'actions de la Société au cours des exercices clos le 31 décembre 2023 ou le 31 décembre 2022.

Aucun Administrateur n'a de contrat de services avec la Société.

CONSEILLERS JURIDIQUES EN DROIT IRLANDAIS

Dillon Eustace LLP fut le Conseiller juridique (en matière de droit irlandais) de la Société durant l'exercice clos le 31 décembre 2023.

COMMISSAIRES AUX COMPTES INDÉPENDANTS

Les Commissaires aux comptes indépendants, PricewaterhouseCoopers, ont exprimé leur volonté de continuer d'exercer leurs fonctions conformément à l'Article 383 de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014.

Au nom du Conseil d'administration

Administrateur : Craig A. Dawson

Administrateur : David M. Kennedy

Date : 25 avril 2024

Rapport des commissaires aux comptes indépendants aux membres de PIMCO Funds: Global Investors Series plc

Rapport sur l'audit des états financiers

Opinion

À notre avis, les états financiers de PIMCO Funds: Global Investors Series plc :

- donnent une image fidèle et exacte des actifs, des passifs et de la situation financière de la Société et des Fonds au 31 décembre 2023 et de leurs résultats pour l'exercice clos à cette date ;
- ont été correctement préparés en vertu des Normes Comptables Généralement Admises en Irlande (normes comptables émises par le Financial Reporting Council du Royaume-Uni, y compris la norme FRS 102 « La norme de présentation de l'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » et le droit irlandais) ; et
- ont été dressés correctement conformément aux exigences de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et à la Réglementation 2011 (telle que modifiée) des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières).

Nous avons procédé à l'audit des états financiers, inclus dans le Rapport annuel, qui sont composés :

- du Bilan au 31 décembre 2023 ;
- du Compte de résultat de l'exercice clos à cette date ;
- de l'État de l'évolution des actifs nets de l'exercice clos à cette date ;
- du Tableau des investissements de chacun des Fonds au 31 décembre 2023 ; et
- des notes relatives aux états financiers de la Société et de chacun de ses Fonds, qui comprennent une description des principales règles comptables.

Fondements de l'opinion

Nous avons mené notre audit conformément aux Normes Internationales d'Audit (Irlande) (« ISA (Irlande) ») et au droit applicable.

Nos responsabilités en vertu des Normes Internationales d'Audit (Irlande) sont décrites plus en détails dans les responsabilités des Commissaires aux comptes pour l'audit de la section de notre rapport consacrée aux états financiers. Nous estimons que les éléments probants d'audit que nous avons obtenus sont suffisants et adéquats pour les fondements de notre opinion.

Indépendance

Nous sommes restés indépendants de la Société conformément aux exigences éthiques pertinentes pour notre audit des états financiers en Irlande, et qui comprennent la Norme éthique de l'IAASA telle qu'applicable aux entités cotées, et nous avons assumé nos autres responsabilités éthiques conformément à ces exigences.

Notre approche d'audit

Aperçu



Seuil de signification

- Seuil de signification global : 50 points de base (2022 : 50 points de base de la Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») au 31 décembre 2023 (2022 : 31 décembre 2022) pour chacun des Fonds de la Société.
- Seuil de signification de la performance : 75 % du seuil de signification global.

Portée de l'audit

- La Société est une société à responsabilité limitée, à capital variable, et engage PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (le « Gestionnaire ») pour gérer certaines obligations et responsabilités concernant la gestion quotidienne de la Société. Nous avons adapté la portée de notre audit pour prendre en compte les types d'investissements au sein des Fonds, l'implication de tiers dont il est fait référence au verso, les processus et contrôles comptables et le secteur dans lequel la Société exerce ses activités. Nous analysons chacun des Fonds au niveau individuel.

Questions clés de l'audit

- Évaluation des actifs et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.
- Existence des actifs et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

La portée de notre audit

Dans le cadre de la conception de notre audit, nous avons identifié le seuil de signification et évalué les risques d'erreur significative dans les états financiers. En particulier, nous nous sommes penchés sur les sections dans lesquelles les administrateurs posent des jugements subjectifs, par exemple la sélection de sources de détermination des prix pour évaluer le portefeuille d'investissement. Comme dans tous nos audits, nous avons également abordé le risque de contournement par la direction des contrôles internes, notamment une évaluation permettant de déterminer s'il existait des preuves de parti pris de la part des administrateurs qui représentaient un risque d'erreur significative en raison d'une fraude.

Questions clés de l'audit

Les questions clés de l'audit sont ces questions qui, selon le jugement professionnel des commissaires aux comptes, étaient les plus importantes dans l'audit des états financiers de la période actuelle et comprennent les risques évalués les plus importants d'erreurs significatives (en raison ou non d'une fraude) identifiés par les commissaires aux comptes, y compris ceux ayant l'effet le plus conséquent sur la stratégie générale d'audit, l'attribution de ressources d'audit et l'orientation des efforts de l'équipe de mission. Ces questions, et tout commentaire fait sur les résultats de nos procédures à ce sujet, ont été abordées dans le contexte de notre audit des états financiers dans leur ensemble, et pour former notre opinion, et nous ne fournissons pas un avis distinct sur ces sujets. Il ne s'agit pas d'une liste exhaustive de tous les risques identifiés dans le cadre de notre audit.

Question clé de l'audit

Évaluation des actifs et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

Veillez vous reporter à l'État des investissements de chacun des Fonds, aux principales méthodes comptables énoncées à la note 2 et à la section Investissements à la juste valeur et hiérarchie de la juste valeur figurant à la note 3. Les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat compris dans l'État des actifs et passifs des Fonds au 31 décembre 2023 sont évalués à la juste valeur conformément aux Principes comptables généralement admis en Irlande. Nous avons considéré que l'évaluation des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat était une question clé de l'audit, car elle représente le principal élément des états financiers.

Existence des actifs et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

Veillez vous reporter à l'État des investissements de chacun des Fonds, aux principales méthodes comptables énoncées à la note 2 et à la section Investissements à la juste valeur et hiérarchie de la juste valeur figurant à la note 3. Les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat compris dans l'État des actifs et passifs de chaque Fonds sont détenus au nom de chaque Fonds au 31 décembre 2023. Nous avons considéré que l'existence des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat était une question clé de l'audit, car elle représente le principal élément des états financiers.

Comment notre audit aborde les questions clés de l'audit

Nous avons testé la valorisation des valeurs mobilières, des dépôts auprès d'établissements de crédit ainsi que la juste valeur des titres vendus à découvert au 31 décembre 2023 auprès de fournisseurs tiers, le cas échéant. En l'absence de sources de fournisseurs tiers disponibles pour certaines positions de niveau 1 ou niveau 2, nous avons mis en œuvre d'autres procédures de test, notamment en obtenant la confirmation de la cotation de la part de courtiers ou grâce au soutien de la direction en matière de tarification.

Nous avons testé la juste valeur des valeurs mobilières présentées comme des investissements appartenant au niveau 3 en examinant les méthodes et les données utilisées par la direction pour développer une estimation de la juste valeur. Nous avons comparé les résultats de notre valorisation indépendante avec celle de la direction afin d'en tirer des conclusions sur le caractère raisonnable des estimations de la direction concernant la juste valeur.

Les fonds d'investissement comprennent les Fonds négociés en bourse et les Organismes de placement collectif. Nous avons testé la valorisation des Fonds négociés en bourse auprès de fournisseurs tiers. Concernant les Organismes de placement collectif, nous avons convenu de la juste valeur selon une confirmation indépendante de l'agent de transfert sous-jacent.

Nous avons testé la juste valeur des contrats de mise en pension en validant la juste valeur aux déclarations de contrepartie.

Nous avons testé la valorisation des instruments financiers dérivés en faisant appel à notre expert en valorisation interne afin de développer une estimation indépendante de la juste valeur et d'en tirer des conclusions sur le caractère raisonnable des estimations de la direction concernant la juste valeur ou en obtenant les prix auprès de fournisseurs tiers, le cas échéant. Ces procédures n'ont identifié aucune inexactitude importante.

Nous avons obtenu une confirmation indépendante de la part du Dépositaire ou de contreparties indépendantes concernant les valeurs mobilières et les dépôts auprès d'établissements de crédit détenus au 31 décembre 2023.

Nous avons rapproché les avoirs selon les confirmations des placements détenus conformément aux livres de comptes et un échantillon d'éléments de rapprochement notés a été testé sur la base des pièces justificatives. Pour la juste valeur des titres vendus à découvert, nous avons obtenu des confirmations indépendantes de la part des contreparties. Les fonds d'investissement comprennent les Fonds négociés en bourse et les Organismes de placement collectif. Pour les Fonds négociés en bourse, nous avons obtenu une confirmation indépendante de la part du Dépositaire. Concernant les Organismes de placement collectif, nous avons obtenu une confirmation indépendante de l'agent de transfert sous-jacent.

Pour les contrats de mise en pension, nous avons obtenu des confirmations indépendantes de la part des contreparties.

S'agissant des instruments financiers dérivés, nous avons obtenu des confirmations indépendantes de la part des contreparties, le cas échéant. En l'absence de confirmation reçue de la part de la contrepartie indépendante, nous avons mis en œuvre d'autres procédures de test sur certaines positions. Pour les contrats de change à terme, nous avons, dans la mesure du possible, effectué des liquidations sur les relevés bancaires. Par ailleurs, lorsqu'une position est importante et que la date d'échéance est postérieure à la date d'approbation de l'audit, nous l'avons confirmée de manière indépendante auprès des contreparties.

Ces procédures n'ont identifié aucune inexactitude importante.

Comment nous avons adapté la portée de l'audit

Nous avons adapté la portée de notre audit pour nous assurer que nous avons fourni assez de travail pour donner un avis sur les états financiers dans leur ensemble, en prenant en compte la structure de la Société, les processus et contrôles comptables et le secteur dans lequel la société exerce ses activités.

Au 31 décembre 2023, 56 Fonds sont en opération. Le Bilan, le Compte de résultat et l'État de l'évolution des actifs nets de la Société sont un cumul des positions et des résultats des Fonds.

Les administrateurs contrôlent les affaires de la Société et sont responsables de la politique d'investissement globale qu'ils déterminent. La Société fait appel à un Gestionnaire pour gérer certaines obligations et responsabilités concernant la gestion quotidienne de la Société. Le Gestionnaire a délégué certaines responsabilités aux Conseillers en investissement et à State Street Fund Services (Ireland) Limited (l'« Agent administratif »). Les états financiers, qui restent la responsabilité des

administrateurs, sont préparés pour leur compte par l'Agent administratif. La Société a nommé State Street Custodial Services (Ireland) Limited (le « Dépositaire ») pour agir en tant que Dépositaire des actifs de la Société. En établissant l'approche globale de notre audit, nous avons évalué le risque d'erreurs significatives au niveau d'un Fonds, en prenant en compte la nature, la probabilité et l'ampleur éventuelle de toute erreur. Dans le cadre de notre évaluation du risque, nous avons pris en compte l'interaction de la Société avec l'Agent administratif, et nous avons évalué l'environnement de contrôle en place chez l'Agent administratif.

Seuil de signification

La portée de notre audit a été influencée par notre application du seuil de signification. Nous avons établi des seuils quantitatifs pour le seuil de signification. De même que les considérations qualitatives, ceux-ci nous ont aidés à déterminer la portée de notre audit, ainsi que la nature, le calendrier et l'étendue de nos procédures d'audit sur les postes individuels et les informations fournies dans les états financiers et à évaluer l'effet d'erreurs, individuellement et de façon globale, sur les états financiers dans leur ensemble.

Selon notre jugement professionnel, nous avons déterminé le seuil de signification pour les états financiers de chacun des Fonds de la Société comme suit :

| | |
|---|---|
| <i>Le seuil de signification global et comment nous l'avons déterminé</i> | 50 points de base (2022 : 50 points de base de la Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») au 31 décembre 2023 (2022 : 31 décembre 2022) pour chacun des Fonds de la Société. |
| <i>Logique derrière le choix de l'indice de référence</i> | Nous avons appliqué cet indice de référence car l'objectif principal de la Société est de fournir aux investisseurs un rendement total au niveau du Fonds, en tenant compte du rendement du capital et des revenus. |

Nous utilisons le seuil de signification de la performance pour réduire à un niveau suffisamment faible la probabilité que l'ensemble des erreurs non corrigées et non détectées dépasse le seuil de signification global. Plus précisément, nous utilisons le seuil de signification de la performance pour déterminer la portée de notre audit, ainsi que la nature et l'étendue de nos tests sur les soldes de comptes, les catégories de transactions et les informations à fournir, par exemple en déterminant la taille des échantillons. Le seuil de signification de la performance s'élevait à 75 % du seuil de signification global.

Pour déterminer le seuil de signification de la performance, nous avons tenu compte d'un certain nombre de facteurs (l'historique des erreurs, l'évaluation des risques et le risque d'agrégation, ainsi que l'efficacité des contrôles) et avons conclu qu'un montant situé dans la partie supérieure de notre fourchette normale était approprié.

Nous avons convenu avec le Conseil d'administration que nous les informerions de toute erreur identifiée pendant notre audit supérieure à 10 % du seuil de signification global, à des fins de différences d'impact de la VNI par action (2022 : 10 % du seuil de signification global, à des fins de différences d'impact de la VNI par action), ainsi que de toute erreur inférieure à ce montant qui, selon nous, justifierait un signalement pour des raisons qualitatives.

Conclusions relatives à la continuité d'exploitation

Notre jugement sur l'évaluation faite par les administrateurs de la capacité de la Société et des Fonds à continuer à adopter une comptabilité sur une base de continuité d'exploitation inclut les étapes suivantes :

- Obtenir une compréhension des indicateurs clés qui sont surveillés en ce qui concerne l'hypothèse de la continuité de l'exploitation et les futurs plans de la direction pour les Fonds sur la période de continuité de l'exploitation (d'une durée de 12 mois à compter de la date d'approbation des états financiers) ;
- Réviser les procès-verbaux des réunions du Conseil d'administration disponibles au cours de la période sous audit et ceux disponibles jusqu'à la date du présent rapport ;
- Prendre en compte l'activité d'investissement postérieure à la fin de l'exercice telle qu'elle est enregistrée dans les registres comptables sous-jacents ;
- Mener des enquêtes de gestion concernant tous les rachats importants prévus dont ils ont été informés ;
- Prendre en considération les techniques de gestion du risque de liquidité qui sont mises à disposition de la Société et des Fonds.

Sur la base du travail que nous avons effectué, nous n'avons identifié aucune incertitude importante concernant des événements ou des conditions qui, individuellement ou collectivement, pourraient mettre en doute, de façon importante, la capacité de la Société et des Fonds à continuer selon le principe de la continuité d'exploitation pour une période d'au moins douze mois à compter de la date à laquelle les états financiers peuvent être émis.

Au cours de notre vérification des états financiers, nous avons conclu que l'utilisation par les administrateurs d'une base de continuité d'exploitation dans la préparation des états financiers était appropriée.

Cependant, comme il n'est pas possible de prédire tous les événements ou conditions futurs, cette conclusion n'est pas une garantie de la capacité de la Société et des Fonds à poursuivre leurs activités selon le principe de continuité d'exploitation.

Nos responsabilités et les responsabilités des administrateurs s'agissant de la continuité d'exploitation sont décrites dans les sections pertinentes du présent rapport.

Rapport concernant d'autres informations

Les autres informations comprennent toutes les informations contenues dans le Rapport annuel autres que les états financiers et notre rapport des commissaires aux comptes à ce sujet. Les administrateurs sont responsables des autres informations. Notre avis concernant les états financiers ne couvre pas les autres informations et, par conséquent, nous ne formulons pas d'opinion d'audit ou, sauf indication contraire explicite dans le présent rapport, toute forme d'assurance les concernant. En rapport avec notre audit des états financiers, notre responsabilité est de lire les autres informations et, ce faisant, de considérer si les autres informations sont matériellement contradictoires avec les états financiers ou notre connaissance obtenue au cours de l'audit, ou semblent par ailleurs contenir des erreurs significatives. Si nous identifions une erreur significative ou un écart important apparent, nous sommes tenus de mettre en œuvre des procédures visant à conclure s'il existe une erreur significative dans les états financiers ou les autres informations. Si, sur la base du travail que nous avons effectué, nous concluons qu'il existe une erreur significative relative aux autres informations, nous nous devons de signaler ce fait. Nous n'avons rien à déclarer sur la base de ces responsabilités.

Concernant le Rapport des Administrateurs, nous avons également vérifié que les divulgations exigées par la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 ont bien été incluses.

Sur la base des responsabilités décrites ci-dessus et du travail entrepris au cours de notre mission d'audit, les ISA (Irlande) et la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 exigent que nous communiquions certains avis et questions tels que décrits ci-dessous :

- Selon nous, en fonction des travaux entrepris dans le cours de l'audit, les informations fournies dans le Rapport des Administrateurs pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 sont conformes aux états financiers et ont été préparées conformément aux exigences légales applicables.
- Sur la foi de notre connaissance et de notre compréhension de la Société et de son environnement, acquises dans le cadre de notre audit, nous n'avons identifié aucune erreur significative dans le Rapport des Administrateurs.

Responsabilités afférentes aux états financiers et à l'audit

Responsabilités des administrateurs afférentes aux états financiers

Comme indiqué plus en détail dans l'énoncé des responsabilités des Administrateurs présenté en page 884, les administrateurs sont tenus de préparer des états financiers conformément au cadre applicable et de s'assurer qu'ils soient fidèles et précis.

Les administrateurs sont également responsables des contrôles internes qu'ils jugent nécessaires pour permettre la préparation d'états financiers qui sont exempts d'erreurs significatives, que celles-ci soient dues à la fraude ou à l'erreur.

Dans la préparation des états financiers, les administrateurs sont responsables de l'évaluation de la capacité de la Société et des Fonds à poursuivre leurs activités selon le principe de continuité d'exploitation, divulguant le cas échéant, des observations relatives à la continuité d'exploitation et appliquant une comptabilité sur la base de la continuité d'exploitation sauf si les administrateurs ont l'intention de liquider la Société ou de cesser l'exploitation, ou n'ont pas d'autres choix réalistes que de le faire.

Responsabilités des commissaires aux comptes à l'égard de l'audit des états financiers

Nos objectifs sont d'obtenir une assurance raisonnable en ce qui concerne les états financiers dans leur ensemble, qu'ils soient exempts d'erreurs significatives, en raison de fraude ou d'erreur, et de publier un rapport des commissaires aux comptes qui comprend notre opinion. Une assurance raisonnable est un niveau d'assurance élevé, mais n'est pas une garantie qu'un audit effectué conformément aux ISA (Irlande) détectera toujours une erreur importante lorsque celle-ci existe. Les erreurs peuvent résulter d'une fraude ou d'une erreur et sont considérées comme significatives si, individuellement ou dans leur ensemble, elles pouvaient raisonnablement avoir une influence sur les décisions économiques des utilisateurs prises sur la base de ces états financiers.

Les irrégularités, y compris les fraudes, sont des cas de non-respect des lois et règlements. Nous concevons des procédures conformes à nos responsabilités, décrites ci-dessus, afin de détecter les erreurs significatives concernant les irrégularités, y compris les fraudes. La mesure dans laquelle nos procédures sont capables de détecter les irrégularités, y compris les fraudes, est détaillée ci-dessous.

Sur la base de notre compréhension de la Société et du secteur, nous avons identifié que les principaux risques de non-conformité aux lois et réglementations en matière d'irrégularités, y compris de fraudes, sont des cas de non-conformité aux lois et réglementations. Nous concevons des procédures conformes à nos responsabilités, décrites ci-dessus, afin de détecter les erreurs significatives concernant les irrégularités, y compris les fraudes. La mesure dans laquelle nos procédures sont capables de détecter les irrégularités, y compris les fraudes, est détaillée ci-dessous, et nous avons examiné la mesure dans laquelle la non-conformité pourrait avoir un effet significatif sur les états financiers. Nous avons également pris en compte les lois et règlements qui ont une incidence directe sur la préparation des états financiers, tels que la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et la Réglementation de 2011 (telle que modifiée) des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières). Nous avons évalué les éventuelles motivations et les possibilités de manipulation frauduleuse des états financiers de la part de la direction (y compris le risque de contournement des contrôles), et avons déterminé que les principaux risques étaient liés au risque de contournement des contrôles par la direction.

Les procédures d'audit appliquées par l'équipe de mission comprenaient :

- enquêter auprès de la direction afin d'identifier tout cas de non-respect des lois et réglementations ;
- identifier et tester les entrées de journal qui répondent à nos critères spécifiques basés sur les risques ;
- tester les estimations comptables ainsi que les jugements et les risques potentiels de biais de la direction ;
- concevoir des procédures d'audit pour intégrer le caractère imprévisible de la nature, du calendrier ou de l'étendue de nos tests ; et
- examiner le procès-verbal des réunions du Conseil d'administration.

Les procédures d'audit décrites ci-dessus comportent des limites inhérentes. Nous sommes moins susceptibles de détecter des cas de non-conformité aux lois et règlements qui ne sont pas étroitement liés aux événements et transactions figurant dans les états financiers. De plus, le risque de non-détection d'une erreur significative résultant d'une fraude est plus élevé que pour une anomalie découlant d'une erreur, car la fraude peut impliquer une dissimulation délibérée, par exemple, par des faux ou de fausses déclarations délibérées, ou par collusion.

Nos tests d'audit peuvent porter sur la totalité de certaines transactions et de certains soldes et peuvent utiliser des techniques de vérification des données. Toutefois, il s'agit généralement de sélectionner un nombre limité d'éléments à tester, plutôt que de tester des ensembles complets. Pour les tests, nous cherchons souvent à cibler des éléments particuliers en fonction de leur taille ou de leurs caractéristiques de risque. Dans d'autres cas, nous vérifions un échantillon pour en tirer une conclusion sur l'ensemble des données dont cet échantillon provient.

Une description plus détaillée de nos responsabilités à l'égard de l'audit des états financiers se trouve sur le site de l'IAASA à l'adresse suivante :

https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Cette description fait partie de notre rapport des commissaires aux comptes indépendants.

Usage du présent rapport

Le présent rapport, y compris les opinions, a été préparé exclusivement pour les membres de la Société en tant qu'organe conformément à l'Article 391 de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, et n'est destiné à aucune autre fin. En donnant ces opinions, nous n'acceptons et n'assumons de responsabilité à aucune autre fin et envers aucune autre personne à laquelle le présent rapport est présenté ou entre les mains de laquelle il pourrait tomber, sauf accord exprès par notre consentement écrit préalable.

Autres exigences

Avis concernant d'autres questions en vertu de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014

- Nous avons obtenu toutes les informations et explications que nous considérons comme étant nécessaires aux fins de notre audit.
- À notre avis, les registres comptables de la Société étaient suffisants pour permettre l'audit facile et correct des états financiers.
- Les états financiers concordent avec les registres comptables.

Rapport d'exception en vertu de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014

Rémunération et transactions des Administrateurs

En vertu de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, nous sommes tenus de vous présenter un rapport si, à notre avis, les informations relatives à la rémunération et aux transactions des administrateurs visées dans les articles 305 à 312 de cette Loi n'ont pas été communiquées. Nous n'avons aucune exception à signaler dans le cadre de cette responsabilité.

Mary Ruane
pour et au nom de PricewaterhouseCoopers
Cabinet d'expertise-comptable et commissaire aux comptes
Dublin
25 Avril 2024

Nous avons étudié la conduite de PIMCO Funds: Global Investors Series plc (la « Société ») pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 en notre qualité de Dépositaire de la Société.

Le présent rapport, y compris l'opinion, a été préparé à la seule intention des actionnaires de la Société, pris en tant qu'organe, conformément à la Réglementation 34, (1), (3) et (4) de la Section 5 de la Réglementation 2011 (telle que modifiée) (« Réglementation sur les OPCVM ») des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières), à l'exclusion de toute autre fin. En exprimant cette opinion, nous n'acceptons ni n'assumons de responsabilité à aucune autre fin et envers aucune autre personne à laquelle le présent rapport est présenté.

RESPONSABILITÉS DU DÉPOSITAIRE

Nos fonctions et responsabilités sont décrites dans la Réglementation 34, (1), (3) et (4) de la Section 5 de la Réglementation sur les OPCVM. Elles comprennent notamment d'enquêter sur la conduite de la Société au cours de chaque exercice et d'en rendre compte aux actionnaires.

Notre rapport indiquera si, à notre avis, la Société a été gérée durant cette période conformément aux dispositions de l'Acte constitutif de la Société (l'« Acte constitutif ») et de la Réglementation sur les OPCVM. Il incombe globalement à la Société de se conformer à ces dispositions. Si la Société ne s'y est pas conformée, nous devons, en tant que Dépositaire, indiquer pourquoi tel est le cas, et décrire les mesures que nous avons prises pour remédier à la situation.

FONDEMENTS DE L'OPINION DU DÉPOSITAIRE

Le Dépositaire procède aux investigations qu'il juge raisonnablement nécessaires en vue de se conformer à ses obligations, tel que décrit dans la Réglementation 34, (1), (3) et (4) de la Section 5 de la Réglementation sur les OPCVM, et de s'assurer que, à tous égards importants, la Société a été gérée (i) en conformité avec les limitations imposées à son pouvoir relatif à l'investissement et à sa capacité d'emprunt par les dispositions de l'Acte constitutif et de la Réglementation sur les OPCVM et (ii) par ailleurs en conformité avec l'Acte constitutif et la réglementation pertinente.

OPINION

À notre avis, la Société a été gérée durant la période comptable, à tous égards importants :

- (i) conformément aux limitations imposées au pouvoir de la Société relatif à l'investissement et à sa capacité d'emprunt par son Acte constitutif, par la Réglementation sur les OPCVM et la Réglementation de 2019 (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) prise en application de l'article 48(1) de la Loi de 2013 de la Banque centrale (supervision et exécution) (Central Bank (Supervision and Enforcement) Act) (« la Réglementation sur les OPCVM de la Banque centrale ») ; et
- (ii) par ailleurs conformément aux dispositions de l'Acte constitutif, de la Réglementation sur les OPCVM et de la Réglementation sur les OPCVM de la Banque centrale.

State Street Custodial Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32
Irlande

Date : 25 avril 2024

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (le « Gestionnaire »), conformément à ses obligations en vertu de la Directive 2009/65/CE, telle que modifiée (la « Directive sur les OPCVM ») est tenu d'avoir des politiques et pratiques de rémunération en place pour les catégories de personnel, dont la haute direction, les preneurs de risques, les fonctions de contrôle et tous les salariés percevant une rémunération qui les classe dans la même fourchette que les membres de la haute direction et les preneurs de risque, dont les activités professionnelles ont une incidence substantielle sur les profils de risque du Gestionnaire ou de tout Organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») géré, qui respectent et promeuvent une gestion du risque saine et efficace et n'encouragent pas une prise de risques incompatible avec les profils de risques, règles ou actes constitutifs du Gestionnaire ou de PIMCO Funds: Global Investors Series plc (la « Société »).

La politique de rémunération comprend également des informations sur l'intégration des risques en matière de durabilité dans les procédures de rémunération du Gestionnaire, comme l'exige le Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

La rémunération se compose de toutes les formes de paiements ou d'avantages accordés directement ou indirectement, mais au nom du Gestionnaire, en contrepartie des services professionnels fournis par le personnel. Cela comprend, le cas échéant : (i) toutes les formes de paiements ou d'avantages versés par le Gestionnaire ; (ii) les montants payés par la Société, y compris toute partie des commissions de performance ; et/ou (iii) tout transfert de parts ou d'actions de toute Société, en échange de services professionnels fournis par le Personnel identifié. La rémunération fixe désigne les paiements ou les avantages sans tenir compte de critères de performance. La rémunération variable correspond aux paiements ou aux avantages supplémentaires accordés en fonction des performances ou, dans certains cas, d'autres critères contractuels.

Des informations sont fournies concernant (a) le personnel du Gestionnaire ; (b) le personnel appartenant à la haute direction ; et (c) le personnel qui a la capacité d'influencer de façon importante le profil de risque du Fonds, y compris les personnes qui, bien que n'étant pas directement employées par le Gestionnaire, sont affectées par leur employeur pour fournir des services directement au Gestionnaire (« Délégués »).

Le montant de la rémunération totale accordée par le Gestionnaire à son personnel, qui a été affecté aux activités liées aux OPCVM du Gestionnaire au titre de l'exercice de ce dernier clos le 31 décembre 2023, s'élève à 180 000 €. Ce montant comprend une rémunération fixe de 180 000 € et une rémunération variable de 0 €. La rémunération décrite ci-dessus a été versée à 3 bénéficiaires au total.

Le montant de la rémunération globale, qui a été attribuée aux activités liées aux OPCVM du Gestionnaire pour l'exercice du Gestionnaire clos le 31 décembre 2023, accordée par celui-ci à sa haute direction s'élève à 0 \$. Pour les autres membres de son personnel dont les actions ont une incidence importante sur le profil de risque des activités liées aux OPCVM du Gestionnaire, le montant s'élève à 0 \$.

Le montant de la rémunération totale attribuée par les Délégués à leur Personnel identifié et attribuée aux compartiments au titre de l'exercice clos le 31 décembre 2023 s'élève à 10 515 112 \$. Ce montant comprend une rémunération fixe de 84 451 \$ et une rémunération variable de 10 430 661 \$. La rémunération décrite ci-dessus a été versée à 62 bénéficiaires au total.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 81 115 936 | \$ 807 852 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 83 957 336 | \$ 836 148 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Standard Chartered PLC 7,750 % éch. 15/08/2027 | \$ 53 700 | 53 836 | Sands China Ltd. 4,300 % éch. 08/01/2026 | \$ 46 100 | 43 795 |
| Obligation internationale du gouvernement mongol 8,650 % éch. 19/01/2028 | 30 770 | 30 509 | Sands China Ltd. 5,375 % éch. 08/08/2025 | 32 400 | 31 942 |
| Shriram Finance Ltd. 4,400 % éch. 13/03/2024 | 28 254 | 27 684 | Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % éch. 22/10/2025 | 25 900 | 25 696 |
| Huarong Finance Co. Ltd. 4,750 % éch. 27/04/2027 | 30 300 | 26 327 | Sands China Ltd. 5,650 % éch. 08/08/2028 | 26 300 | 25 511 |
| Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 3,250 % éch. 05/05/2026 | 32 250 | 24 086 | Standard Chartered PLC 7,750 % éch. 15/08/2027 | 21 400 | 21 290 |
| Dah Sing Bank Ltd. 7,375 % éch. 15/11/2033 | 22 200 | 22 070 | Muthoot Finance Ltd. 4,400 % éch. 02/09/2023 | 21 400 | 21 059 |
| Standard Chartered PLC 6,000 % éch. 26/07/2025 | 22 100 | 21 613 | Freeport Indonesia PT 5,315 % éch. 14/04/2032 | 21 800 | 20 424 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,650 % éch. 20/09/2032 | 21 684 | 21 457 | VLL International, Inc. 5,750 % éch. 28/11/2024 | 20 900 | 20 328 |
| Bangkok Bank PCL 5,000 % éch. 23/09/2025 | 20 300 | 19 266 | Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,650 % éch. 20/09/2032 | 21 684 | 20 028 |
| Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % éch. 29/05/2029 | 19 300 | 15 271 | Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % éch. 20/05/2026 | 23 400 | 18 533 |
| SK Hynix, Inc. 6,375 % éch. 17/01/2028 | 15 200 | 15 126 | NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % éch. 16/03/2025 | 19 300 | 17 178 |
| Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 2,700 % éch. 13/01/2025 | 21 200 | 15 109 | Krung Thai Bank PCL 4,400 % éch. 25/03/2026 | 18 800 | 17 128 |
| Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % éch. 19/08/2025 | 15 600 | 14 077 | Obligation internationale du gouvernement mongol 8,650 % éch. 19/01/2028 | 16 800 | 16 709 |
| Northern Star Resources Ltd. 6,125 % éch. 11/04/2033 | 14 094 | 13 810 | Periama Holdings LLC 5,950 % éch. 19/04/2026 | 17 200 | 16 546 |
| Wanda Properties Global Co. Ltd. 11,000 % éch. 20/01/2025 | 14 000 | 13 668 | Vedanta Resources Finance PLC 8,950 % éch. 11/03/2025 | 23 100 | 16 385 |
| India Cleantech Energy 4,700 % éch. 10/08/2026 | 15 450 | 13 571 | India Green Power Holdings 4,000 % éch. 22/02/2027 | 18 100 | 15 666 |
| GS Caltex Corp. 5,375 % éch. 07/08/2028 | 13 600 | 13 552 | Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % éch. 29/05/2029 | 18 800 | 15 614 |
| ReNew Wind Energy AP2 4,500 % éch. 14/07/2028 | 15 800 | 13 431 | Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % éch. 29/07/2026 | 15 800 | 14 868 |
| FWD Group Holdings Ltd. 6,375 % éch. 13/09/2024 | 15 270 | 13 266 | NWD Finance BVI Ltd. 5,250 % éch. 22/03/2026 | 16 200 | 13 870 |

(a) Le Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 15 771 481 | \$ 157 062 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 17 599 287 | \$ 175 260 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Korea Housing Finance Corp. 4,625 % éch. 24/02/2028 | \$ 7 100 | 7 039 | Korea Housing Finance Corp. 4,625 % éch. 24/02/2028 | \$ 7 100 | 6 901 |
| Kasikornbank PCL 5,458 % éch. 07/03/2028 | 5 600 | 5 600 | Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,650 % éch. 20/09/2032 | 6 900 | 6 766 |
| BOC Aviation Ltd. 6,667 % éch. 26/09/2023 | 4 000 | 4 001 | Korea National Oil Corp. 2,125 % éch. 18/04/2027 | 5 300 | 4 808 |
| POSCO 5,750 % éch. 17/01/2028 | 3 700 | 3 682 | Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % éch. 29/05/2029 | 6 000 | 4 770 |
| Export-Import Bank of Korea 5,000 % éch. 11/01/2028 | 3 500 | 3 520 | Kasikornbank PCL 5,458 % éch. 07/03/2028 | 4 200 | 4 284 |
| Korea National Oil Corp. 4,875 % éch. 03/04/2028 | 3 500 | 3 506 | ONGC Videsh Ltd. 3,750 % éch. 07/05/2023 | 4 100 | 4 082 |
| SK Hynix, Inc. 2,375 % éch. 19/01/2031 | 4 620 | 3 477 | Korea Electric Power Corp. 5,375 % éch. 06/04/2026 | 4 000 | 3 985 |
| SMBC Aviation Capital Finance DAC 5,450 % éch. 03/05/2028 | 3 400 | 3 401 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b) | 4 315 | 3 656 |
| SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026 | 3 400 | 3 397 | Export-Import Bank of Korea 5,000 % éch. 11/01/2028 | 3 500 | 3 573 |
| China Life Insurance Overseas Co. Ltd. 5,350 % éch. 15/08/2033 | 3 000 | 3 000 | SK Hynix, Inc. 2,375 % éch. 19/01/2031 | 4 600 | 3 492 |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT 5,500 % éch. 04/04/2026 | 2 900 | 2 888 | Periama Holdings LLC 5,950 % éch. 19/04/2026 | 3 500 | 3 378 |
| Shriram Finance Ltd. 4,400 % éch. 13/03/2024 | 2 680 | 2 600 | SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026 | 3 400 | 3 368 |
| India Toll Roads 5,500 % éch. 19/08/2024 | 2 700 | 2 594 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % éch. 06/06/2027 | 3 200 | 3 165 |
| NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % éch. 10/03/2028 | 3 550 | 2 523 | Celestial Miles Ltd. 5,750 % éch. 31/01/2024 | 3 100 | 3 014 |
| Vietnam Debt & Asset Trading Corp. 1,000 % éch. 10/10/2025 | 2 900 | 2 458 | Airport Authority Hong Kong 2,500 % éch. 12/01/2032 | 3 600 | 2 979 |
| Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp. 5,375 % éch. 11/05/2028 | 2 450 | 2 431 | CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 3,875 % éch. 19/06/2029 | 3 200 | 2 933 |
| Standard Chartered PLC 6,301 % éch. 09/01/2029 | 2 300 | 2 303 | Korea National Oil Corp. 4,875 % éch. 03/04/2028 | 2 900 | 2 849 |
| Huarong Finance Co. Ltd. 5,000 % éch. 19/11/2025 | 2 500 | 2 251 | Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % éch. 21/07/2028 | 3 100 | 2 683 |
| Woori Bank 4,875 % éch. 26/01/2028 | 2 200 | 2 192 | India Green Energy Holdings 5,375 % éch. 29/04/2024 | 2 700 | 2 650 |

(a) Le Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--------------------------------------|-----------------------|---|--------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | |
| | 25 221 337 | \$ 251 166 | | 40 324 229 | \$ 401 606 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 05/06/2023 | ¥ 9 458 000 | 69 376 | Bons du Trésor japonais 2,150 % éch. 01/09/2052 | ¥ 9 458 000 | 63 188 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 04/09/2023 | 9 458 000 | 67 755 | Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 22/01/2024 | 8 387 000 | 56 051 |
| Bons du Trésor japonais 2,150 % éch. 01/09/2052 | 9 458 000 | 64 797 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 25 779 | 24 202 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 18/07/2023 | 8 387 000 | 63 708 | Obligation internationale du gouvernement chinois 3,280 % éch. 03/12/2027 | CNY 139 660 | 20 181 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 10/04/2023 | 8 387 000 | 63 277 | Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 30/11/2030 | \$ 18 500 | 18 892 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 16/10/2023 | 8 387 000 | 60 523 | Bons du Trésor japonais 2,980 % éch. 18/03/2031 | ¥ 2 520 000 | 16 837 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 22/01/2024 | 8 387 000 | 56 067 | Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 163 150 | 9 702 |
| Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 30/11/2030 | \$ 41 000 | 41 384 | Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/04/2023 | ¥ 1 162 000 | 8 781 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | 39 930 | 39 441 | | | |
| | ACTIONS | | | ACTIONS | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a) | 272 100 | 27 050 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Capital Securities Fund (a) | 747 114 | 8 120 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 11/01/2024 | \$ 25 400 | 25 256 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % éch. 01/09/2030 | CLP 5 200 000 | 5 986 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 12/06/2023 | ¥ 2 520 000 | 18 493 | Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 05/07/2023 | ILS 18 900 | 5 389 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 11/09/2023 | 2 520 000 | 18 090 | Prologis, Inc. | 42 264 | 4 763 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/11/2053 | \$ 17 400 | 17 811 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor japonais 2,980 % éch. 18/03/2031 | ¥ 2 520 000 | 17 073 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 11/01/2024 | \$ 4 500 | 4 485 |
| | ACTIONS | | Berry Global, Inc. | 4 500 | 4 389 |
| Apple, Inc. | 82 221 | 15 656 | 4,875 % éch. 15/07/2026 | | |
| Microsoft Corp. | 39 364 | 15 066 | Invitation Homes, Inc. | 104 896 | 3 508 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/10/2053 | \$ 9 300 | 9 437 | Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % éch. 01/04/2024 | \$ 3 400 | 3 375 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/04/2023 | ¥ 1 162 000 | 8 899 | TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033 | COP 14 473 700 | 3 332 |
| | | | | ACTIONS | |
| | | | Equinix, Inc. | 3 871 | 3 085 |

(a) Le Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO Capital Securities Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 25/05/2023 | \$ 276 400 | \$ 274 978 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 23/02/2023 | \$ 224 500 | \$ 224 137 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 12/09/2023 | 262 100 | 257 809 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 06/06/2023 | 206 000 | 204 755 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 02/05/2023 | 209 100 | 208 300 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 02/05/2023 | 177 400 | 177 147 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 06/06/2023 | 206 000 | 204 571 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 06/04/2023 | 155 000 | 154 338 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 16/05/2023 | 195 000 | 194 351 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 30/05/2023 | 140 800 | 140 627 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 04/05/2023 | 181 000 | 180 758 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 05/10/2023 | 138 800 | 138 658 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 07/03/2023 | 155 900 | 155 783 | Bons du Trésor américain 3,250 % éch. 14/01/2025 | 130 500 | 130 462 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 06/04/2023 | 155 000 | 153 281 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 04/04/2023 | 127 000 | 126 909 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 28/12/2023 | 155 000 | 152 912 | Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % | € 111 600 | 108 716 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 04/04/2023 | 152 500 | 151 928 | Bons du Trésor américain 1,125 % éch. 27/03/2025 | \$ 107 600 | 106 965 |
| Federal Home Loan Bank 5,330 % éch. 25/09/2023 | 143 100 | 143 100 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 12/09/2023 | 104 800 | 104 492 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 30/05/2023 | 140 800 | 140 387 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 22/08/2023 | 98 400 | 97 944 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 05/10/2023 | 138 800 | 137 013 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 16/02/2023 | 96 700 | 96 371 |
| Bons du Trésor américain 3,250 % éch. 14/01/2025 | 130 500 | 129 609 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 17/08/2023 | 94 900 | 94 384 |
| Crédit Agricole S.A. 7,250 % éch. 23/09/2028 | € 117 500 | 125 610 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 28/12/2023 | 89 500 | 89 212 |
| Bons du Trésor américain 1,125 % éch. 27/03/2025 | \$ 107 600 | 106 724 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 26/09/2023 | 85 600 | 84 966 |
| Bons du Trésor américain 2,226 % éch. 21/01/2026 | 106 800 | 105 589 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % éch. 29/03/2024 | € 76 600 | 80 898 |
| Federal Home Loan Bank 5,070 % éch. 25/08/2023 | 104 700 | 104 700 | HSBC Holdings PLC 4,750 % éch. 04/07/2029 | 83 102 | 78 626 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 23/01/2024 | 105 900 | 104 314 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 02/03/2023 | \$ 77 200 | 77 065 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 11/01/2024 | 99 400 | 98 697 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 14/11/2023 | 74 500 | 74 297 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 22/08/2023 | 98 400 | 97 617 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 25/05/2023 | 74 100 | 74 050 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 17/08/2023 | 94 900 | 93 687 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 07/03/2023 | 72 600 | 72 569 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 09/05/2023 | 90 300 | 89 905 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 25/04/2023 | 72 700 | 72 565 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 26/09/2023 | 85 600 | 84 494 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 21/12/2023 | 71 000 | 70 691 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 21/03/2023 | 77 400 | 77 153 | Société Générale S.A. 6,221 % éch. 15/06/2033 | 70 100 | 66 370 |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO Climate Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------------|-----------------------|--|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 20/04/2023 | \$ 15 500 | \$ 15 498 | Billets du Trésor américain 0,375 % éch. 30/11/2025 | \$ 7 490 | \$ 6 751 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 16/06/2023 | 15 500 | 15 383 | Billets du Trésor américain 1,125 % éch. 15/01/2025 | 3 600 | 3 378 |
| Bons du Trésor américain 0,637 % éch. 26/07/2024 | 15 000 | 14 948 | BNP Paribas S.A. 0,500 % éch. 04/06/2026 | € 2 900 | 2 873 |
| Bons du Trésor américain 3,250 % éch. 14/01/2025 | 15 000 | 14 947 | HAT Holdings LLC 3,750 % éch. 15/09/2030 | \$ 3 200 | 2 426 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/10/2023 | 6 402 | 5 903 | India Green Energy Holdings 5,375 % éch. 29/04/2024 | 2 100 | 2 050 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 09/06/2023 | 5 200 | 5 162 | PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % éch. 26/01/2027 | 2 000 | 1 956 |
| Banque européenne d'investissement 3,750 % éch. 14/02/2033 | 5 000 | 4 974 | Dominion Energy, Inc. 2,250 % éch. 15/08/2031 | 2 350 | 1 944 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 28/04/2023 | 4 900 | 4 898 | DTE Electric Co. 1,900 % éch. 01/04/2028 | 2 200 | 1 936 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 25/04/2023 | 3 000 | 3 000 | Liberty Utilities Finance GP 2,050 % éch. 15/09/2030 | 2 475 | 1 911 |
| Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/07/2028 | 2 400 | 2 396 | LeasePlan Corp. NV 0,250 % éch. 23/02/2026 | € 2 000 | 1 910 |
| New York State Electric & Gas Corp. 5,650 % éch. 15/08/2028 | 2 300 | 2 295 | Avangrid, Inc. 3,800 % éch. 01/06/2029 | \$ 1 965 | 1 827 |
| Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % éch. 26/04/2027 | € 2 100 | 2 271 | Schaeffler AG 3,375 % éch. 12/10/2028 | € 1 700 | 1 776 |
| Nordea Bank Abp 6,000 % éch. 02/06/2026 | £ 1 800 | 2 236 | DNB Bank ASA 3,625 % éch. 16/02/2027 | 1 700 | 1 751 |
| Hyundai Capital America 5,800 % éch. 26/06/2025 | \$ 2 200 | 2 197 | Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % éch. 15/08/2031 | \$ 2 050 | 1 674 |
| TDC Net A/S 5,618 % éch. 06/02/2030 | € 1 900 | 2 071 | Assicurazioni Generali SpA 4,125 % éch. 04/05/2026 | € 1 400 | 1 535 |
| PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % éch. 26/01/2027 | \$ 2 000 | 2 000 | Thermo Fisher Scientific Finance BV 0,000 % éch. 18/11/2025 | 1 400 | 1 372 |
| Kering S.A. 5,125 % éch. 23/11/2026 | £ 1 500 | 1 866 | Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % éch. 05/09/2027 | 1 300 | 1 316 |
| DNB Bank ASA 3,625 % éch. 16/02/2027 | € 1 700 | 1 825 | Forvia SE 2,375 % éch. 15/06/2029 | 1 500 | 1 296 |
| Régie Autonome des Transports Parisiens 3,250 % éch. 11/04/2033 | 1 400 | 1 523 | ING Groep NV 4,875 % éch. 16/05/2029 | \$ 1 600 | 1 289 |
| Bank of America Corp. 4,134 % éch. 12/06/2028 | 1 400 | 1 500 | Schneider Electric SE 3,250 % éch. 12/06/2028 | € 1 200 | 1 260 |
| | | | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/07/2028 | \$ 1 200 | 1 207 |
| | | | Verallia S.A. 1,625 % éch. 14/05/2028 | € 1 300 | 1 193 |
| | | | Bank of Ireland Group PLC 4,875 % éch. 16/07/2028 | 1 100 | 1 185 |
| | | | AES Corp. 1,375 % éch. 15/01/2026 | \$ 1 300 | 1 168 |
| | | | Compass Group PLC 4,375 % éch. 08/09/2032 | £ 1 000 | 1 155 |
| | | | NXP BV 5,000 % éch. 15/01/2033 | \$ 1 100 | 1 086 |
| | | | Valeo 1,000 % éch. 03/08/2028 | € 1 200 | 1 032 |
| | | | SCE Recovery Funding LLC 5,112 % éch. 14/12/2049 | \$ 1 000 | 985 |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Commodity Real Return Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b) | \$ 67 092 | \$ 68 212 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | \$ 123 211 | \$ 121 551 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2027 (b) | 32 610 | 31 392 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b) | 69 400 | 68 136 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/01/2027 (b) | 29 412 | 28 049 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 70 232 | 68 058 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/01/2029 (b) | 25 643 | 24 419 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (b) | 70 611 | 67 130 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,250 % éch. 15/04/2028 (b) | 15 379 | 14 821 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2025 (b) | 36 646 | 35 028 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | 14 271 | 14 144 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2023 (b) | 33 655 | 33 338 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 22/11/2027 (b) | 13 843 | 13 229 | Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027 | £ 18 952 | 24 730 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b) | 14 865 | 13 173 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b) | \$ 23 664 | 23 102 |
| Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027 | £ 8 161 | 10 368 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b) | 22 925 | 22 077 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | \$ 8 410 | 7 827 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | 20 504 | 20 005 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b) | 7 025 | 6 594 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b) | 19 256 | 18 236 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % éch. 26/05/2025 | € 4 584 | 4 796 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2026 (b) | 19 151 | 18 038 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2029 | ¥ 487 980 | 3 465 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/07/2028 (b) | 18 037 | 17 297 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b) | \$ 2 121 | 2 109 | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2026 | £ 12 796 | 15 454 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 04/01/2024 | HUF 422 000 | 1 223 | Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 143 495 | 15 268 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/09/2052 | \$ 651 | 618 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b) | \$ 13 946 | 13 850 |
| UBS Group AG 2,593 % éch. 11/09/2025 | 600 | 546 | Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053 | DKK 120 718 | 13 193 |
| UBS Group AG 4,965 % éch. 16/01/2026 | € 400 | 394 | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 10/08/2041 | £ 4 546 | 5 123 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/11/2052 | \$ 350 | 332 | Carbone CLO Ltd. 6,817 % éch. 20/01/2031 | \$ 4 576 | 4 535 |
| | | | Madison Park Funding Ltd. 6,405 % éch. 15/04/2029 | 4 483 | 4 441 |
| | | | (a) Le Fonds Commodity Real Return Fund investit dans des actions d'un fonds affilié. | | |
| | | | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation. | | |
| | | | Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. | | |
| | | | Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille. | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 644 | 6 | | | |

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|--|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | | | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | | |
| (a) | 2 876 308 | \$ 28 648 | (a) | 3 484 218 | \$ 34 700 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 29/02/2028 | \$ 15 000 | 14 888 | Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 29/02/2028 | \$ 15 000 | 15 246 |
| Billets du Trésor américain 0,500 % éch. 31/10/2027 | 9 900 | 8 560 | Billets du Trésor américain 0,500 % éch. 31/10/2027 | 7 100 | 6 032 |
| Billets du Trésor américain 4,500 % éch. 15/11/2023 | 4 100 | 4 300 | Billets du Trésor américain 4,500 % éch. 15/11/2023 | 4 100 | 4 302 |
| JPMorgan Chase & Co. 3,540 % éch. 01/05/2028 | 2 200 | 2 013 | Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 31/08/2027 | 3 825 | 3 727 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 13/02/2024 | 2 000 | 1 967 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 13/02/2024 | 2 000 | 1 968 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 03/10/2023 | 1 700 | 1 686 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 03/10/2023 | 1 700 | 1 694 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 09/11/2023 | 1 600 | 1 579 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 09/11/2023 | 1 600 | 1 592 |
| AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % éch. 14/08/2024 | 1 150 | 1 102 | JPMorgan Chase & Co. 4,912 % éch. 25/07/2033 | 1 400 | 1 331 |
| Netflix, Inc. 4,875 % éch. 15/04/2028 | 1 100 | 1 060 | Netflix, Inc. 5,375 % éch. 15/11/2029 | 1 300 | 1 319 |
| NextEra Energy Operating Partners LP 4,250 % éch. 15/07/2024 | 1 000 | 976 | Bank of America Corp. 5,015 % éch. 22/07/2033 | 1 350 | 1 267 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/09/2053 | 998 | 961 | Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032 | 1 300 | 1 196 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/09/2052 | 1 005 | 954 | Crown Castle, Inc. 2,250 % éch. 15/01/2031 | 1 200 | 1 001 |
| Carnival Corp. 4,000 % éch. 01/08/2028 | 1 100 | 952 | NextEra Energy Operating Partners LP 4,250 % éch. 15/07/2024 | 1 000 | 991 |
| Leidos, Inc. 2,300 % éch. 15/02/2031 | 1 200 | 952 | Buckeye Partners LP 1,000 % éch. 01/11/2026 | 986 | 986 |
| Boston Scientific Corp. 2,650 % éch. 01/06/2030 | 1 100 | 922 | Citigroup, Inc. 6,270 % éch. 17/11/2033 | 900 | 972 |
| MGM China Holdings Ltd. 4,750 % éch. 01/02/2027 | 1 000 | 916 | USI, Inc. 1,000 % éch. 02/12/2026 | 970 | 970 |
| Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 31/10/2028 | 900 | 914 | Air Canada 3,875 % éch. 15/08/2026 | 1 025 | 923 |
| Mattel, Inc. 3,375 % éch. 01/04/2026 | 900 | 828 | Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 31/10/2028 | 900 | 918 |
| Plains All American Pipeline LP 4,500 % éch. 15/12/2026 | 800 | 762 | RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % éch. 16/11/2025 | 936 | 876 |

(a) Le Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Diversified Income Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------------|-----------------------|--|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 53 896 641 | \$ 536 771 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 59 389 431 | \$ 591 433 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Federal Home Loan Bank 2,125 % éch. 12/02/2027 | \$ 175 600 | 175 600 | Federal Home Loan Bank 3,356 % éch. 29/11/2023 | \$ 88 500 | 88 505 |
| Federal Home Loan Bank 3,356 % éch. 29/11/2023 | 158 500 | 158 500 | WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % éch. 30/03/2029 | € 62 100 | 67 253 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 04/01/2024 | HUF 11 991 000 | 34 745 | Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027 | \$ 55 900 | 51 340 |
| Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 3,450 % éch. 02/02/2061 | \$ 34 500 | 24 317 | Setanta Aircraft Leasing DAC 7,610 % éch. 05/11/2028 | 48 800 | 48 721 |
| CIFC Funding Ltd. 6,710 % éch. 24/04/2030 | 23 154 | 23 112 | CommScope, Inc. 4,750 % éch. 01/09/2029 | 65 600 | 47 954 |
| Occidental Petroleum Corp. 6,625 % éch. 01/09/2030 | 20 900 | 22 475 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (a) | 3 637 652 | 40 252 |
| Verizon Communications, Inc. 2,355 % éch. 15/03/2032 | 26 800 | 21 956 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,375 % éch. 12/09/2033 | € 20 675 | 21 766 | NatWest Group PLC 4,800 % éch. 05/04/2026 | \$ 40 275 | 39 116 |
| Venture Global LNG, Inc. 8,375 % éch. 01/06/2031 | \$ 21 725 | 21 725 | | ACTIONS | |
| Federal Home Loan Bank 5,090 % éch. 09/05/2023 | 21 500 | 21 500 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a) | 4 307 334 | 37 000 |
| Federal Home Loan Bank 1,000 % éch. 09/03/2027 | 21 500 | 21 500 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Netflix, Inc. 4,875 % éch. 15/06/2030 | 21 000 | 20 854 | Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % éch. 30/09/2023 | \$ 38 200 | 36 947 |
| Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,875 % éch. 18/07/2033 | 20 000 | 20 272 | Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026 | £ 34 300 | 35 353 |
| Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 5,000 % éch. 18/01/2053 | 20 000 | 19 153 | Petroleos Mexicanos 6,700 % éch. 16/02/2032 | \$ 45 800 | 35 164 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,750 % éch. 21/11/2033 | 15 000 | 19 142 | Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % éch. 02/10/2026 | € 48 900 | 35 006 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,500 % éch. 31/01/2050 | 26 100 | 18 889 | BNP Paribas S.A. 1,904 % éch. 30/09/2028 | \$ 35 700 | 30 160 |
| Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028 | 18 775 | 18 775 | Altice Financing S.A. 5,750 % éch. 15/08/2029 | 38 200 | 29 928 |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. 10,100 % éch. 15/12/2043 | PEN 68 400 | 18 452 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (a) | 3 159 591 | 27 850 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 6,375 % éch. 18/09/2033 | € 16 400 | 17 481 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| | | | Renault S.A. 2,375 % éch. 25/05/2026 | € 28 600 | 27 795 |
| | | | Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % éch. 22/06/2026 | \$ 27 523 | 27 488 |
| | | | HSBC Holdings PLC 4,300 % éch. 08/03/2026 | 26 700 | 26 026 |
| | | | Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027 | € 27 500 | 25 884 |
| | | | Banco de Sabadell S.A. 5,375 % éch. 08/09/2026 | 22 100 | 24 129 |
| | | | Ford Motor Credit Co. LLC 4,675 % éch. 01/12/2024 | 21 600 | 23 428 |

(a) Le Fonds Diversified Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|--------------------------------------|-----------------------|--|--------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 4 371 880 | \$ 43 543 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 3 678 983 | \$ 36 642 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 09/03/2023 | \$ 21 900 | 21 785 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 26/01/2023 | \$ 8 000 | 7 994 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 17/10/2023 | 15 200 | 15 075 | | ACTIONS | |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 17/08/2023 | 8 500 | 8 390 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (a) | 538 168 | 6 006 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 20/04/2023 | 8 000 | 7 908 | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a) | 651 264 | 5 601 |
| Federal Home Loan Bank 5,090 % éch. 09/05/2023 | 7 500 | 7 500 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/05/2043 | 4 100 | 3 773 | Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027 | \$ 5 200 | 4 754 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,400 % éch. 09/02/2028 | 2 800 | 2 794 | CommScope, Inc. 4,750 % éch. 01/09/2029 | 5 800 | 4 486 |
| Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,750 % éch. 31/12/2032 | 2 985 | 2 746 | Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % éch. 22/06/2026 | 4 185 | 4 180 |
| Obligations du Trésor américain 4,375 % éch. 15/08/2043 | 2 900 | 2 729 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 20/04/2023 | 4 100 | 4 053 |
| Obligation internationale du gouvernement d'Arabie Saoudite 4,875 % éch. 18/07/2033 | 2 500 | 2 521 | WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % éch. 30/03/2029 | € 3 700 | 4 023 |
| CIFC Funding Ltd. 6,710 % éch. 24/04/2030 | 2 263 | 2 259 | Altice Financing S.A. 5,750 % éch. 15/08/2029 | \$ 4 500 | 3 586 |
| Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028 | 2 200 | 2 200 | Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026 | £ 3 300 | 3 509 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 5,000 % éch. 27/09/2026 | € 2 000 | 2 190 | Deutsche Bank AG 1,750 % éch. 19/11/2030 | € 3 600 | 3 176 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudite 4,750 % éch. 18/01/2028 | \$ 2 000 | 1 993 | Deutsche Bank AG 3,547 % éch. 18/09/2031 | \$ 3 600 | 3 022 |
| Gaci First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030 | 2 000 | 1 979 | Renault S.A. 2,375 % éch. 25/05/2026 | € 3 000 | 2 982 |
| Occidental Petroleum Corp. 7,875 % éch. 15/09/2031 | 1 700 | 1 936 | ZF Finance GmbH 3,750 % éch. 21/09/2028 | 3 100 | 2 934 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 04/01/2024 | HUF 664 000 | 1 924 | Level 3 Financing, Inc. 7,220 % éch. 01/03/2027 | \$ 3 226 | 2 845 |
| Verizon Communications, Inc. 2,355 % éch. 15/03/2032 | \$ 2 200 | 1 802 | Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026 | € 2 600 | 2 736 |
| Pertamina Persero PT 6,500 % éch. 07/11/2048 | 1 700 | 1 760 | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % éch. 28/04/2025 | 2 700 | 2 709 |
| | | | CGG S.A. 8,750 % éch. 01/04/2027 | \$ 3 100 | 2 669 |
| | | | Petroleos Mexicanos 6,625 % éch. 15/06/2035 | 3 800 | 2 607 |
| | | | Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % éch. 30/09/2023 | 2 400 | 2 320 |
| | | | | ACTIONS | |
| | | | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (a) | 250 000 | 2 255 |
| | | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| | | | UniCredit SpA 7,830 % éch. 04/12/2023 | \$ 2 200 | 2 240 |
| | | | Casino Guichard-Perrachon S.A. 7,108 % éch. 31/08/2025 | € 2 600 | 2 190 |
| | | | Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % éch. 02/10/2026 | 3 000 | 2 182 |
| | | | Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,708 % éch. 22/06/2028 | \$ 2 140 | 2 142 |

(a) Le Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépasse nt 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Diversified Income ESG Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (a) | 466 614 | \$ 4 748 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (a) | 147 887 | 1 485 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Federal Home Loan Bank 1,000 % éch. 31/01/2029 | \$ 1 100 | 1 100 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 15/03/2023 | 1 100 | 1 100 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 10/03/2023 | 1 000 | 1 000 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 16/03/2023 | 1 000 | 1 000 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 13/03/2023 | 1 000 | 1 000 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/04/2053 | 1 000 | 993 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 15/06/2023 | 1 000 | 988 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/03/2053 | 1 000 | 937 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/05/2053 | 912 | 919 |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen 5,100 % éch. 18/06/2050 | 700 | 720 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 03/05/2023 | 700 | 699 |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen 6,700 % éch. 26/01/2036 | 600 | 648 |
| Bank of America Corp. 6,204 % éch. 10/11/2028 | 600 | 627 |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 4,500 % éch. 30/01/2030 | 600 | 530 |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % éch. 06/06/2032 | 500 | 509 |
| JPMorgan Chase & Co. 2,580 % éch. 22/04/2032 | 600 | 504 |
| Obligation internationale du gouvernement omanais 6,000 % éch. 01/08/2029 | 500 | 501 |
| Sprint Capital Corp. 8,750 % éch. 15/03/2032 | 400 | 492 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (a) | 114 213 | \$ 1 166 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 15/06/2023 | \$ 700 | 695 |
| Obligation internationale du gouvernement omanais 6,000 % éch. 01/08/2029 | 500 | 494 |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 4,500 % éch. 30/01/2030 | 500 | 434 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 09/03/2023 | 400 | 398 |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen 5,100 % éch. 18/06/2050 | 400 | 393 |
| BNP Paribas S.A. 1,675 % éch. 30/06/2027 | 400 | 355 |
| Enel Finance International NV 2,875 % éch. 11/04/2029 | £ 300 | 329 |
| KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029 | \$ 300 | 301 |
| B.C. Unlimited Liability Co. 4,000 % éch. 15/10/2030 | 350 | 297 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,875 % éch. 19/05/2033 | 300 | 265 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 3,000 % éch. 15/01/2034 | 300 | 250 |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 6,500 % éch. 15/02/2048 | 300 | 246 |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien 4,750 % éch. 14/01/2050 | 300 | 219 |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen 4,500 % éch. 19/01/2063 | 300 | 219 |
| Obligation internationale du gouvernement omanais 6,750 % éch. 17/01/2048 | 200 | 199 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 10/05/2023 | 200 | 198 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,750 % éch. 12/10/2110 | 225 | 198 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034 | 200 | 190 |
| Owens & Minor, Inc. 6,625 % éch. 01/04/2030 | 200 | 182 |
| FMG Resources Pty. Ltd. 4,375 % éch. 01/04/2031 | 200 | 181 |
| Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 6,125 % éch. 15/06/2033 | 200 | 180 |
| Catalent Pharma Solutions, Inc. 3,125 % éch. 15/02/2029 | 200 | 168 |
| Graphic Packaging International LLC 3,500 % éch. 01/03/2029 | 200 | 167 |
| Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % éch. 03/05/2028 | 200 | 162 |
| Obligation internationale du gouvernement chilien 3,100 % éch. 07/05/2041 | 200 | 153 |
| Obligation internationale du gouvernement paraguayen 5,400 % éch. 30/03/2050 | 200 | 150 |
| Post Holdings, Inc. 5,500 % éch. 15/12/2029 | 150 | 140 |
| Obligation internationale du gouvernement marocain 4,000 % éch. 15/12/2050 | 200 | 138 |
| MPT Operating Partnership LP 3,500 % éch. 15/03/2031 | 200 | 137 |

(a) Le Fonds Diversified Income ESG Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Dynamic Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|--|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 11/01/2024 | \$ 225 000 | \$ 223 751 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 15 986 067 | \$ 159 200 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/04/2023 | ¥ 23 470 000 | 179 750 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 31/07/2023 | 23 470 000 | 174 672 | | | |
| | ACTIONS | | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/01/2024 | BRL 253 700 | 52 121 |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 14 933 834 | 148 732 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 11/01/2024 | \$ 27 000 | 26 901 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 24/01/2023 | 13 200 | 13 173 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 24/08/2023 | \$ 147 400 | 145 502 | Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 20/07/2023 | 11 100 | 11 079 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 26/05/2023 | 119 800 | 119 516 | Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 01/05/2023 | 10 600 | 10 564 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 11/05/2023 | 78 300 | 78 289 | Deutsche Bank AG 6,119 % éch. 14/07/2026 | 8 902 | 8 769 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | 77 740 | 71 091 | | ACTIONS | |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/01/2024 | BRL 342 670 | 67 400 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a) | 84 200 | 8 388 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 71 075 | 67 286 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | 66 670 | 64 648 | Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026 | £ 7 600 | 8 095 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 15/06/2023 | 58 000 | 57 332 | Caesars Entertainment Corp. 8,452 % éch. 06/02/2030 | \$ 5 495 | 5 481 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/07/2024 | BRL 266 600 | 52 112 | CPI Property Group S.A. 2,750 % éch. 22/01/2028 | £ 5 950 | 5 119 |
| Federal Home Loan Bank 2,125 % éch. 12/02/2027 | \$ 47 000 | 47 000 | Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % éch. 09/03/2027 | \$ 6 204 | 5 028 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 04/01/2024 | HUF 16 036 000 | 46 466 | Bank of America Corp. 4,125 % éch. 22/01/2024 | 5 050 | 4 993 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 16/03/2023 | \$ 45 000 | 44 994 | | ACTIONS | |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 17/03/2023 | 42 700 | 42 695 | Nationwide Building Society | 31 074 | 4 778 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 29/06/2023 | HUF 13 739 000 | 40 630 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 27/07/2023 | 13 646 000 | 40 414 | Federal Home Loan Bank 0,000 % éch. 16/05/2023 | \$ 4 600 | 4 592 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 09/11/2023 | 14 673 000 | 40 409 | BNP Paribas S.A. 4,400 % éch. 14/08/2028 | 4 800 | 4 451 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 02/11/2023 | 14 700 000 | 40 303 | HSI Asset Securitization Corp. Trust 6,250 % éch. 25/01/2036 | 5 700 | 4 442 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/07/2023 | 13 604 000 | 40 224 | Banco Santander S.A. 5,147 % éch. 18/08/2025 | 4 400 | 4 302 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 09/07/2023 | 13 888 000 | 39 936 | U.S. Foods, Inc. 7,970 % éch. 22/11/2028 | 4 008 | 4 003 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 22/06/2023 | 13 696 000 | 39 869 | Volkswagen Financial Services NV 1,125 % éch. 18/09/2023 | £ 3 300 | 3 829 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 06/07/2023 | 13 520 000 | 39 563 | | | |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 19/10/2023 | 14 376 000 | 39 369 | (a) Le Fonds Dynamic Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié. | | |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 26/10/2023 | 14 380 000 | 39 339 | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation. | | |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 03/08/2023 | 13 686 000 | 39 305 | Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. | | |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 31/08/2023 | 13 851 000 | 39 186 | Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille. | | |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 28/09/2023 | 14 008 000 | 39 031 | | | |

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Dynamic Multi-Asset Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) |
|--|-------------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | \$ 596 057 | € 521 863 |
| Bons du Trésor français 0,000 % éch. 13/09/2023 | € 186 960 | 185 506 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b) | \$ 187 147 | 176 014 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | 179 512 | 164 394 |
| SNCF Réseau 4,500 % éch. 30/01/2024 | € 119 300 | 119 351 |
| Obligation internationale du gouvernement français 4,250 % éch. 25/10/2023 | 117 260 | 117 530 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 26/06/2023 | ¥ 15 410 000 | 109 714 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 25/09/2023 | 15 410 000 | 98 546 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 04/04/2023 | 13 690 000 | 97 240 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 10/07/2023 | 13 690 000 | 95 054 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 12/06/2023 | 13 440 000 | 93 067 |
| Bons du trésor britannique 0,000 % éch. 11/03/2024 | £ 80 050 | 92 035 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 04/04/2024 | ¥ 14 150 000 | 90 312 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 25/12/2023 | 14 170 000 | 90 175 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 11/09/2023 | 13 440 000 | 89 688 |
| Bons du Trésor japonais 4,250 % éch. 27/07/2027 | 13 690 000 | 87 962 |
| Bons du Trésor japonais 2,375 % éch. 07/07/2023 | 12 460 000 | 79 726 |
| Bons du Trésor japonais 2,980 % éch. 18/03/2031 | 12 140 000 | 76 759 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 15/01/2024 | 9 220 000 | 58 608 |
| Bons du Trésor français 0,000 % éch. 30/08/2023 | € 53 160 | 52 839 |
| Bons du Trésor français 0,000 % éch. 16/03/2022 | 47 000 | 47 008 |
| Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2023 | 45 430 | 45 337 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | \$ 479 825 | € 404 513 |
| ACTIONS | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 1 878 900 | 182 462 |
| VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b) | \$ 193 418 | 173 893 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | 184 621 | 155 183 |
| Bons du Trésor français 0,000 % éch. 13/09/2023 | € 144 960 | 144 579 |
| Bons du Trésor de l'Union européenne 0,000 % éch. 03/03/2023 | 135 230 | 134 944 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % éch. 28/04/2023 | 82 600 | 82 171 |
| Bons de l'Union européenne 0,000 % éch. 07/04/2023 | 66 430 | 66 178 |
| ACTIONS | | |
| Vertex Pharmaceuticals, Inc. | 192 000 | 60 007 |
| VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| Obligation internationale du gouvernement italien 0,000 % éch. 31/03/2023 | € 56 400 | 56 206 |
| Bons du Trésor du Mécanisme européen de stabilité 0,000 % éch. 19/01/2023 | 54 100 | 54 065 |
| ACTIONS | | |
| Exxon Mobil Corp. | 512 000 | 49 522 |
| VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 06/03/2023 | ¥ 7 000 000 | 48 827 |
| ACTIONS | | |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 2 955 000 | 48 521 |
| Humana, Inc. | 104 455 | 47 011 |
| Panasonic Holdings Corp. | 4 421 740 | 44 440 |
| VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| Bons du Trésor français 0,000 % éch. 15/03/2023 | € 44 500 | 44 365 |
| ACTIONS | | |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc. | 60 700 | 42 844 |
| VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| Bons du Trésor du Mécanisme européen de stabilité 0,000 % éch. 09/03/2023 | € 41 300 | 41 212 |
| ACTIONS | | |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 837 600 | 40 466 |

(a) Le Fonds Dynamic Multi-Asset Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Local Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|---|--------------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 210 458 673 | \$ 2 095 880 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030 ZAR | 2 343 500 | 116 540 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033 THB | 3 294 778 | 100 382 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,350 % éch. 17/06/2026 | 3 247 762 | 95 107 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,000 % éch. 03/09/2026 MXN | 1 576 190 | 86 566 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 ZAR | 1 472 800 | 83 982 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,400 % éch. 17/03/2029 THB | 3 057 040 | 83 678 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 22/06/2023 HUF | 26 816 000 | 78 061 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 15/06/2023 | 26 728 000 | 77 462 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 25/05/2023 | 26 465 000 | 77 063 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 01/06/2023 | 26 551 000 | 76 511 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 08/06/2023 | 26 639 000 | 76 343 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % éch. 01/04/2033 CLP | 57 325 000 | 73 139 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % éch. 17/06/2028 THB | 2 263 201 | 67 815 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 MXN | 1 317 427 | 65 611 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,250 % éch. 17/03/2027 THB | 2 223 090 | 63 028 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 27/07/2023 HUF | 21 103 000 | 62 498 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/07/2023 | 21 105 000 | 62 403 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 29/06/2023 | 20 907 000 | 61 828 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 09/07/2023 | 21 483 000 | 61 776 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|--------------------------------------|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 200 663 390 | \$ 1 998 400 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,350 % éch. 17/06/2026 THB | 3 247 762 | 95 252 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033 | 2 847 758 | 86 607 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,000 % éch. 03/09/2026 MXN | 1 576 190 | 84 248 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien 3,990 % éch. 15/10/2025 MYR | 353 679 | 79 905 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,500 % éch. 04/03/2027 MXN | 1 583 300 | 78 557 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 ZAR | 1 251 400 | 69 363 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,000 % éch. 06/03/2025 MXN | 1 173 200 | 61 851 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 10/04/2023 ¥ | 7 646 000 | 58 866 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028 MYR | 262 638 | 58 821 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033 PEN | 206 800 | 57 771 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,390 % éch. 17/06/2037 THB | 1 874 307 | 57 316 |
| TES colombien 9,250 % éch. 28/05/2042 COP | 290 345 000 | 53 535 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % éch. 17/06/2028 THB | 1 758 630 | 50 306 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 7,000 % éch. 15/02/2033 IDR | 681 081 000 | 47 647 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030 ZAR | 1 004 200 | 47 564 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 4,500 % éch. 17/06/2024 RON | 212 500 | 45 884 |
| Obligation internationale du gouvernement chinois 3,030 % éch. 11/03/2026 CNY | 308 500 | 43 891 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,940 % éch. 12/02/2029 PEN | 135 000 | 36 176 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,000 % éch. 30/11/2028 MXN | 574 629 | 32 461 |

(a) Le Fonds Emerging Local Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Local Bond ESG Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) |
|---|-----|-------------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | |
| TES colombien 7,000 % éch. 26/03/2031 | COP | 15 275 200 | \$ 3 196 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 04/01/2024 | HUF | 693 000 | 2 008 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 8,250 % éch. 15/05/2036 | IDR | 21 808 000 | 1 576 |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque 0,050 % éch. 29/11/2029 | CZK | 41 700 | 1 469 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/04/2032 | IDR | 19 987 000 | 1 273 |
| Banque européenne d'investissement 2,875 % éch. 15/11/2029 | PLN | 4 900 | 1 065 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 8,750 % éch. 15/05/2031 | IDR | 14 069 000 | 1 014 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 4,250 % éch. 28/04/2036 | RON | 5 765 | 1 002 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 | MXN | 19 093 | 955 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 4,850 % éch. 22/04/2026 | RON | 4 400 | 928 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,885 % éch. 15/08/2029 | MYR | 3 720 | 803 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,130 % éch. 09/07/2029 | | 3 550 | 775 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 4,150 % éch. 26/01/2028 | RON | 3 800 | 757 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 2,632 % éch. 15/04/2031 | MYR | 3 810 | 755 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/08/2028 | IDR | 11 778 000 | 754 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 8,375 % éch. 15/03/2034 | | 9 314 000 | 674 |
| TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033 | COP | 2 343 000 | 661 |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois 4,500 % éch. 27/05/2032 | HUF | 221 900 | 554 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien 3,465 % éch. 15/10/2030 | MYR | 2 500 | 526 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 4,762 % éch. 07/04/2037 | | 2 222 | 514 |
| Banque internationale pour la reconstruction et le développement 6,750 % éch. 09/02/2029 | ZAR | 10 300 | 501 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 4,150 % éch. 24/10/2030 | RON | 2 600 | 492 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,400 % éch. 17/03/2029 | THB | 17 160 | 486 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028 | MYR | 2 100 | 463 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/04/2042 | IDR | 7 139 000 | 442 |

| DESCRIPTION | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-----|-------------------------------------|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 2,750 % éch. 25/10/2029 | PLN | 3 500 | \$ 781 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 21/03/2023 | \$ | 400 | 400 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 21/02/2023 | | 400 | 399 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 06/04/2023 | | 400 | 397 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 10/05/2023 | | 400 | 396 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 03/10/2023 | | 300 | 299 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,350 % éch. 17/06/2026 | THB | 10 109 | 297 |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 11,250 % éch. 15/09/2035 | DOP | 11 900 | 219 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR | 3 600 | 215 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % éch. 17/06/2028 | THB | 7 179 | 213 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 03/08/2023 | \$ | 200 | 199 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 07/09/2023 | | 200 | 199 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 04/04/2023 | | 200 | 199 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 26/09/2023 | | 200 | 198 |
| Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 15/02/2024 | | 200 | 198 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033 | KRW | 251 040 | 177 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,000 % éch. 03/09/2026 | MXN | 3 330 | 176 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 3,250 % éch. 29/04/2024 | RON | 800 | 171 |
| Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 13,625 % éch. 10/02/2034 | DOP | 7 700 | 162 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033 | THB | 5 140 | 157 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,130 % éch. 09/07/2029 | MYR | 690 | 153 |
| Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023 | ILS | 500 | 148 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033 | PEN | 500 | 140 |
| Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 02/08/2023 | ILS | 500 | 140 |
| Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028 | MYR | 610 | 136 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023 | ILS | 500 | 136 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,390 % éch. 17/06/2037 | THB | 3 900 | 125 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 7,500 % éch. 25/07/2028 | PLN | 500 | 119 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,500 % éch. 26/05/2033 | MXN | 2 300 | 118 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 6,500 % éch. 28/02/2041 | ZAR | 3 300 | 112 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,800 % éch. 17/08/2023 | MYR | 500 | 111 |
| Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 05/07/2023 | ILS | 400 | 111 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023 | ¥ | 14 000 | 108 |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Markets Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 196 830 296 | \$ 1 960 293 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,000 % éch. 03/12/2026 | MXN 809 324 | 42 597 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 39 500 | 41 520 |
| Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 28/02/2030 | \$ 33 100 | 32 946 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 484 900 | 28 930 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien 4,875 % éch. 18/07/2033 | \$ 28 400 | 28 065 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien 4,750 % éch. 18/01/2028 | \$ 27 600 | 27 504 |
| Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 6,915 % éch. 28/06/2024 | € 25 500 | 27 042 |
| Obligation internationale du gouvernement serbe 6,500 % éch. 26/09/2033 | \$ 24 000 | 23 739 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,800 % éch. 17/08/2023 | MYR 107 200 | 22 992 |
| CBB International Sukuk Programme Co. 6,250 % éch. 18/10/2030 | \$ 21 000 | 21 000 |
| Obligation internationale du gouvernement serbe 6,250 % éch. 26/05/2028 | \$ 20 250 | 20 207 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 4,875 % éch. 04/10/2033 | \$ 19 000 | 18 854 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 30/11/2023 | HUF 6 482 000 | 18 434 |
| Obligation internationale du gouvernement sénégalais 5,375 % éch. 08/06/2037 | € 24 000 | 18 142 |
| Suci Second Investment Co. 6,000 % éch. 25/10/2028 | \$ 17 400 | 17 327 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,350 % éch. 09/02/2035 | \$ 16 400 | 16 340 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 22/01/2024 | ¥ 2 280 000 | 16 095 |
| Obligation internationale du gouvernement nigérian 6,500 % éch. 28/11/2027 | \$ 18 844 | 15 749 |
| Banco do Brasil S.A. 8,500 % éch. 29/07/2026 | MXN 294 000 | 15 378 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 183 139 485 | \$ 1 823 900 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien 4,875 % éch. 18/07/2033 | \$ 28 400 | 26 689 |
| CBB International Sukuk Programme Co. 6,250 % éch. 18/10/2030 | \$ 21 000 | 21 171 |
| Nogaholding Sukuk Ltd. 6,625 % éch. 25/05/2033 | \$ 13 900 | 13 893 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023 | ILS 54 100 | 13 654 |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien 4,750 % éch. 16/04/2026 | € 14 508 | 13 585 |
| Obligation internationale du gouvernement nigérian 6,500 % éch. 28/11/2027 | \$ 15 300 | 13 243 |
| Obligation internationale du gouvernement chilien 2,750 % éch. 31/01/2027 | \$ 13 400 | 12 720 |
| Obligation internationale du gouvernement serbe 1,650 % éch. 03/03/2033 | € 16 700 | 12 333 |
| Obligation internationale du gouvernement des Bahamas 6,000 % éch. 21/11/2028 | \$ 14 550 | 11 955 |
| Standard Chartered PLC 7,767 % éch. 16/11/2028 | \$ 11 200 | 11 943 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien 4,000 % éch. 26/02/2024 | \$ 12 100 | 11 933 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 1,750 % éch. 13/07/2030 | € 13 200 | 11 209 |
| Obligation internationale du gouvernement serbe 6,250 % éch. 26/05/2028 | \$ 10 650 | 10 560 |
| Obligation internationale du gouvernement jordanien 5,750 % éch. 31/01/2027 | \$ 10 800 | 10 557 |
| ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % éch. 16/07/2025 | \$ 11 800 | 10 381 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,338 % éch. 04/05/2053 | \$ 10 400 | 9 841 |
| Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,850 % éch. 11/01/2033 | \$ 9 700 | 9 754 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,400 % éch. 09/02/2028 | \$ 9 500 | 9 723 |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,250 % éch. 16/06/2029 | \$ 9 400 | 9 139 |

(a) Le Fonds Emerging Markets Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) |
|---|-------------------------------|--------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,000 % éch. 03/12/2026 | MXN 604 727 | \$ 31 827 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 4,875 % éch. 04/10/2033 | \$ 25 500 | 25 131 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/10/2053 | 25 008 | 23 765 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,875 % éch. 19/05/2033 | 24 900 | 23 745 |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen 5,750 % éch. 28/10/2034 | 21 900 | 23 381 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 324 500 | 19 365 |
| Obligation internationale du gouvernement brésilien 6,250 % éch. 18/03/2031 | \$ 19 200 | 18 926 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/07/2053 | 19 875 | 18 850 |
| Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048 | 18 200 | 18 370 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/09/2053 | 18 991 | 18 124 |
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. 4,875 % éch. 25/07/2033 | 18 000 | 17 923 |
| Département des finances du gouvernement de Sharjah 6,500 % éch. 23/11/2032 | 17 600 | 17 659 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023 | ILS 62 400 | 17 333 |
| Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 6,915 % éch. 28/06/2024 | € 16 000 | 16 968 |
| Obligation internationale du gouvernement turc 9,125 % éch. 13/07/2030 | \$ 16 900 | 16 739 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,800 % éch. 17/08/2023 | MYR 74 400 | 15 957 |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois 6,750 % éch. 25/09/2052 | \$ 16 600 | 15 891 |
| Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042 | 17 500 | 15 314 |
| Obligation internationale du gouvernement serbe 1,000 % éch. 23/09/2028 | € 16 900 | 14 247 |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. 5,000 % éch. 27/07/2028 | \$ 14 200 | 14 096 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/05/2053 | 14 652 | 13 965 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,350 % éch. 09/02/2035 | 14 000 | 13 948 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 30/11/2023 | HUF 4 801 000 | 13 653 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------|-----------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023 | ILS 152 300 | \$ 40 645 |
| Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 31/08/2029 | \$ 24 800 | 22 675 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023 | ILS 79 600 | 21 341 |
| Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042 | \$ 25 300 | 20 849 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 5,500 % éch. 16/11/2027 | 15 800 | 16 049 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,350 % éch. 09/02/2035 | 14 000 | 14 659 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 4,300 % éch. 12/10/2028 | 14 500 | 13 268 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 4,500 % éch. 17/01/2033 | 13 400 | 13 224 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 5,875 % éch. 20/04/2032 | 13 500 | 12 538 |
| Obligation internationale du gouvernement chilien 2,750 % éch. 31/01/2027 | 12 900 | 12 245 |
| OTP Bank Nyrt 8,750 % éch. 15/05/2033 | 12 300 | 12 194 |
| Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,000 % éch. 22/02/2027 | € 10 600 | 11 416 |
| Obligation internationale du gouvernement serbe 6,250 % éch. 26/05/2028 | \$ 10 950 | 10 915 |
| Obligation internationale du gouvernement argentin 3,625 % éch. 09/07/2035 | 41 500 | 10 864 |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. 3,500 % éch. 10/09/2051 | 13 700 | 9 575 |
| Obligation internationale du gouvernement philippin 3,200 % éch. 06/07/2046 | 12 900 | 9 534 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien 6,125 % éch. 18/01/2041 | 11 400 | 8 922 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 2,750 % éch. 25/05/2032 | € 9 100 | 8 888 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,400 % éch. 09/02/2028 | \$ 8 700 | 8 829 |
| Fondo MIVIVIENDA S.A. 4,625 % éch. 12/04/2027 | 9 100 | 8 823 |
| Banque de développement et de commerce d'Afrique orientale et australe 4,125 % éch. 30/06/2028 | 10 900 | 8 701 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 4,250 % éch. 31/03/2023 | ILS 30 500 | 8 658 |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen 7,875 % éch. 15/01/2033 | \$ 6 930 | 8 532 |
| Obligation internationale du gouvernement égyptien 5,250 % éch. 06/10/2025 | 10 600 | 8 431 |
| Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,750 % éch. 31/12/2032 | 8 942 | 8 222 |
| Standard Chartered PLC 7,767 % éch. 16/11/2028 | 7 600 | 8 104 |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrees, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 5 985 427 | \$ 59 607 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023 | ¥ 430 000 | 3 373 |
| Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2033 | \$ 2 200 | 2 200 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034 | 1 500 | 1 489 |
| KazMunayGas National Co. JSC 6,375 % éch. 24/10/2048 | 1 500 | 1 277 |
| QNB Finance Ltd. 1,375 % éch. 26/01/2026 | 1 400 | 1 268 |
| Bank Hapoalim B.M. 3,255 % éch. 21/01/2032 | 1 300 | 1 153 |
| Seazen Group Ltd. 4,450 % éch. 13/07/2025 | 1 400 | 1 132 |
| Abu Dhabi National Energy Co. PJSC 4,375 % éch. 24/01/2029 | 1 100 | 1 093 |
| Medco Maple Tree Pte Ltd. 8,960 % éch. 27/04/2029 | 1 000 | 988 |
| Ecopetrol S.A. 0,000 % éch. 17/08/2024 | 1 000 | 965 |
| ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd. 3,750 % éch. 27/07/2026 | 1 000 | 954 |
| Export-Credit Bank of Turkey 9,375 % éch. 31/01/2026 | 900 | 912 |
| BBVA Bancomer S.A. 8,450 % éch. 29/06/2038 | 800 | 804 |
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co. 4,875 % éch. 25/07/2033 | 800 | 797 |
| Sands China Ltd. 5,650 % éch. 08/08/2028 | 800 | 777 |
| NBK SPC Ltd. 1,625 % éch. 15/09/2027 | 800 | 714 |
| SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026 | 700 | 699 |
| Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği A/S 8,250 % éch. 15/11/2028 | 700 | 693 |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd. 5,000 % éch. 24/07/2028 | 700 | 681 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 6 956 780 | \$ 69 280 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023 | ILS 6 000 | 1 650 |
| Bank Leumi Le-Israel B.M. 3,275 % éch. 29/01/2031 | \$ 1 800 | 1 631 |
| QNB Finance Ltd. 3,500 % éch. 28/03/2024 | 1 548 | 1 524 |
| Fab Sukuk Co. Ltd. 3,875 % éch. 22/01/2024 | 1 500 | 1 492 |
| LG Chem Ltd. 3,625 % éch. 15/04/2029 | 1 600 | 1 445 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034 | 1 500 | 1 433 |
| Bank Hapoalim B.M. 3,255 % éch. 21/01/2032 | 1 500 | 1 265 |
| Mizrahi Tefahot Bank Ltd. 3,077 % éch. 07/04/2031 | 1 300 | 1 167 |
| Banco Santander Chile 2,700 % éch. 10/01/2025 | 1 200 | 1 162 |
| Abu Dhabi National Energy Co. PJSC 4,375 % éch. 24/01/2029 | 1 100 | 1 061 |
| New Metro Global Ltd. 6,800 % éch. 05/08/2023 | 1 100 | 1 055 |
| Woori Bank 4,750 % éch. 30/04/2024 | 1 000 | 995 |
| India Green Energy Holdings 5,375 % éch. 29/04/2024 | 1 000 | 983 |
| Rio Oil Finance Trust 8,200 % éch. 06/04/2028 | 968 | 973 |
| MAF Sukuk Ltd. 4,638 % éch. 14/05/2029 | 1 000 | 973 |
| ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % éch. 24/01/2028 | 1 000 | 962 |
| Export-Credit Bank of Turkey 8,250 % éch. 24/01/2024 | 900 | 903 |
| Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2033 | 900 | 872 |
| S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % éch. 17/06/2031 | 1 000 | 871 |

(a) Le Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 31 038 839 | \$ 309 129 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | \$ 15 449 | 13 798 |
| Obligations du Trésor américain 1,125 % éch. 15/05/2040 | 17 500 | 11 093 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033 | PEN 33 800 | 9 363 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,000 % éch. 06/03/2025 | MXN 182 400 | 8 782 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % éch. 01/04/2033 | CLP 6 390 000 | 8 227 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,000 % éch. 03/09/2026 | MXN 148 000 | 8 043 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 134 500 | 7 474 |
| Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 6,000 % éch. 31/07/2030 | \$ 12 920 | 6 194 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 0,250 % éch. 25/10/2026 | PLN 33 200 | 5 997 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 5 300 | 5 571 |
| Credicorp Capital Sociedad Tituladora S.A. 10,100 % éch. 15/12/2043 | PEN 20 500 | 5 530 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5,800 % éch. 01/10/2034 | CLP 5 300 000 | 5 269 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 | MXN 105 981 | 5 161 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien 4,875 % éch. 18/07/2033 | \$ 5 200 | 5 139 |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,253 % éch. 15/03/2035 | 16 700 | 5 087 |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,750 % éch. 01/08/2041 | 9 900 | 4 944 |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 3,750 % éch. 25/05/2027 | PLN 19 000 | 4 476 |
| Billets de la Banque centrale de République dominicaine 13,000 % éch. 05/12/2025 | DOP 269 700 | 4 461 |
| Obligations du Trésor américain 1,750 % éch. 15/08/2041 | \$ 5 400 | 3 808 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 32 441 730 | \$ 323 100 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligations du Trésor américain 2,375 % éch. 15/02/2042 | \$ 14 900 | 11 348 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,000 % éch. 06/03/2025 | MXN 182 400 | 8 865 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033 | PEN 24 400 | 6 636 |
| Billets du Trésor américain 2,500 % éch. 30/04/2024 | \$ 5 600 | 5 537 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien 4,875 % éch. 18/07/2033 | 5 200 | 5 317 |
| Obligations du Trésor américain 3,375 % éch. 15/08/2042 | 4 000 | 3 773 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030 | ZAR 75 100 | 3 715 |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,253 % éch. 15/03/2035 | \$ 12 500 | 3 563 |
| Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,750 % éch. 01/08/2041 | 7 400 | 3 497 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % éch. 01/04/2033 | CLP 2 320 000 | 3 004 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,200 % éch. 12/08/2026 | PEN 11 000 | 2 997 |
| Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % éch. 07/05/2029 | \$ 2 800 | 2 520 |
| Petroleos Mexicanos 6,500 % éch. 02/06/2041 | 4 000 | 2 466 |
| Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 6,000 % éch. 31/07/2030 | 5 100 | 2 386 |
| Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042 | 2 500 | 2 315 |
| Korea Electric Power Corp. 5,375 % éch. 31/07/2026 | 2 300 | 2 279 |
| Banque de développement hongroise 6,500 % éch. 29/06/2028 | 2 200 | 2 205 |
| Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % éch. 01/12/2040 | 2 567 | 2 204 |
| Obligation internationale du gouvernement philippin 5,000 % éch. 17/07/2033 | 2 100 | 2 156 |

(a) Le Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|--|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023 | ¥ 350 000 | \$ 2 746 | Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023 | ¥ 350 000 | \$ 2 695 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,800 % éch. 17/08/2023 | MYR 5 400 | 1 158 | Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,000 % éch. 03/12/2026 | MXN 15 860 | 859 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 30/11/2023 | HUF 403 000 | 1 146 | Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 03/05/2023 | ILS 1 600 | 438 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,000 % éch. 03/12/2026 | MXN 19 683 | 1 022 | Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,000 % éch. 03/09/2026 | MXN 7 900 | 412 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 27/04/2023 | HUF 306 000 | 882 | Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033 | PEN 1 300 | 362 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/11/2026 | ZAR 15 500 | 881 | ACTIONS | | |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/04/2023 | HUF 164 000 | 479 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a) | 3 400 | 338 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 13/04/2023 | | 470 | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,000 % éch. 03/09/2026 | MXN 7 900 | 433 | Export-Import Bank of Korea 4,890 % éch. 09/08/2023 | INR 26 600 | 322 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033 | PEN 1 300 | 353 | Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 | MXN 6 025 | 290 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 | MXN 7 109 | 348 | Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 3 600 | 229 |
| Export-Import Bank of Korea 4,890 % éch. 09/08/2023 | INR 26 600 | 322 | Suci Second Investment Co. 6,000 % éch. 25/10/2028 | \$ 200 | 211 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,000 % éch. 01/10/2028 | CLP 285 000 | 321 | Bank Gospodarstwa Krajowego 6,250 % éch. 31/10/2028 | 200 | 211 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030 | ZAR 6 200 | 306 | Standard Chartered PLC 6,170 % éch. 09/01/2027 | 200 | 204 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 200 | 210 | Danske Bank A/S 6,466 % éch. 09/01/2026 | 200 | 203 |
| ACTIONS | | | TES colombien 9,250 % éch. 28/05/2042 | COP 1 167 800 | 203 |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 20 221 | 201 | Banque de développement hongroise 6,500 % éch. 29/06/2028 | \$ 200 | 202 |
| VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | Gaci First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030 | 200 | 202 |
| Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2033 | \$ 200 | 200 | Korea Electric Power Corp. 5,375 % éch. 31/07/2026 | 200 | 199 |
| Danske Bank A/S 6,466 % éch. 09/01/2026 | 200 | 200 | Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2033 | 200 | 198 |
| Standard Chartered PLC 6,170 % éch. 09/01/2027 | 200 | 200 | Lloyds Banking Group PLC 4,716 % éch. 11/08/2026 | 200 | 196 |
| Bank Gospodarstwa Krajowego 6,250 % éch. 31/10/2028 | 200 | 200 | Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % éch. 29/07/2026 | 200 | 185 |
| Korea Electric Power Corp. 5,375 % éch. 31/07/2026 | 200 | 200 | TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033 | COP 663 500 | 168 |
| Suci Second Investment Co. 6,000 % éch. 25/10/2028 | 200 | 199 | Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053 | DKK 1 467 | 166 |
| Korea Southern Power Co. Ltd. 5,375 % éch. 21/09/2026 | 200 | 199 | Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,500 % éch. 03/06/2027 | MXN 2 600 | 142 |
| Gaci First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030 | 200 | 198 | Obligation internationale du gouvernement colombien 4,375 % éch. 21/03/2023 | COP 676 600 | 138 |
| Banque de développement hongroise 6,500 % éch. 29/06/2028 | 200 | 198 | Obligation internationale du gouvernement colombien 4,375 % éch. 21/03/2023 | 676 600 | 137 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % éch. 01/04/2033 | CLP 155 000 | 192 | Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,750 % éch. 29/05/2031 | MXN 2 300 | 129 |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. 10,100 % éch. 15/12/2043 | PEN 700 | 189 | | | |

(a) Le Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO ESG Income Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/08/2053 | \$ 23 800 | \$ 22 975 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/06/2053 | 21 446 | 21 528 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/08/2053 | 14 733 | 13 534 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/08/2053 | 8 100 | 7 973 |
| EMF-UK PLC 6,319 % éch. 13/03/2046 | £ 3 566 | 4 219 |
| TDC Net A/S 5,618 % éch. 06/02/2030 | € 2 700 | 2 944 |
| Ginnie Mae 5,500 % éch. 20/07/2053 | \$ 2 495 | 2 490 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (a) | 2 547 | 2 455 |
| Great Hall Mortgages PLC 5,599 % éch. 18/06/2038 | £ 2 040 | 2 387 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/08/2053 | \$ 2 500 | 2 359 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/07/2053 | 2 411 | 2 316 |
| Ginnie Mae 5,500 % éch. 20/08/2053 | 2 100 | 2 095 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/07/2053 | 1 927 | 1 806 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (a) | 1 842 | 1 780 |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,470 % éch. 25/01/2037 | 3 177 | 1 752 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (a) | 1 702 | 1 654 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/10/2053 | 1 807 | 1 556 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 5,891 % éch. 20/10/2051 | £ 1 300 | 1 540 |
| Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048 | \$ 1 500 | 1 500 |
| Verizon Communications, Inc. 5,050 % éch. 09/05/2033 | 1 500 | 1 498 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048 | \$ 1 500 | \$ 1 560 |
| Viridis European Loan Conduit 5,724 % éch. 22/07/2029 | £ 900 | 1 095 |
| Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % éch. 21/01/2032 | \$ 950 | 841 |
| Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % éch. 15/07/2026 | 680 | 585 |
| Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 5,250 % éch. 11/01/2053 | 500 | 546 |
| Clearway Energy Operating LLC 3,750 % éch. 15/02/2031 | 630 | 538 |
| Forvia SE 2,750 % éch. 15/02/2027 | € 500 | 511 |
| Verallia S.A. 1,625 % éch. 14/05/2028 | 500 | 487 |
| Natura Cosmetics S.A. 4,125 % éch. 03/05/2028 | \$ 600 | 482 |
| Prosus NV 3,061 % éch. 13/07/2031 | 600 | 469 |
| Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % éch. 01/07/2029 | 500 | 448 |
| Verallia S.A. 1,875 % éch. 10/11/2031 | € 500 | 447 |
| Transalta Corp. 7,750 % éch. 15/11/2029 | \$ 400 | 421 |
| Nokia Oyj 3,125 % éch. 15/05/2028 | € 400 | 419 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % éch. 24/09/2023 | 400 | 414 |
| Radian Group, Inc. 6,625 % éch. 15/03/2025 | \$ 400 | 399 |
| Banco do Brasil S.A. 4,875 % éch. 11/01/2029 | 400 | 377 |
| DaVita, Inc. 3,750 % éch. 15/02/2031 | 400 | 323 |
| Coty, Inc. 3,875 % éch. 15/04/2026 | € 300 | 317 |
| Rexel S.A. 2,125 % éch. 15/12/2028 | 300 | 287 |
| Owens Corning 3,950 % éch. 15/08/2029 | \$ 300 | 286 |
| Prosus NV 3,257 % éch. 19/01/2027 | 300 | 274 |
| Starwood Property Trust, Inc. 4,375 % éch. 15/01/2027 | 310 | 266 |
| Intesa Sanpaolo SpA 6,250 % éch. 16/05/2024 | € 200 | 214 |
| Sixt SE 1,750 % éch. 09/12/2024 | 200 | 211 |
| Allegion U.S. Holding Co., Inc. 3,550 % éch. 01/10/2027 | \$ 200 | 190 |
| Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % éch. 29/07/2026 | 200 | 188 |
| Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,125 % éch. 15/06/2028 | 200 | 183 |
| NextEra Energy Operating Partners LP 3,875 % éch. 15/10/2026 | 180 | 169 |
| Greenko Dutch BV 3,850 % éch. 29/03/2026 | 188 | 169 |
| Société Générale S.A. 4,750 % éch. 26/05/2026 | 200 | 166 |
| Greenko Power Ltd. 4,300 % éch. 13/12/2028 | 191 | 165 |
| BNP Paribas S.A. 2,871 % éch. 19/04/2032 | 200 | 164 |
| Blue Owl Capital Corp. 2,875 % éch. 11/06/2028 | 200 | 164 |
| MPT Operating Partnership LP 3,375 % éch. 24/04/2030 | £ 200 | 150 |

(a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 1 343 400 | € 131 425 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,750 % éch. 01/07/2024 | € 70 000 | 68 838 |
| Obligation internationale du gouvernement français 2,500 % éch. 24/09/2026 | 61 600 | 60 830 |
| Obligation internationale du gouvernement français 2,750 % éch. 25/02/2029 | 51 300 | 50 951 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,100 % éch. 01/02/2029 | 34 700 | 35 684 |
| | ACTIONS | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 283 500 | 27 505 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,600 % éch. 31/10/2029 | € 31 800 | 27 391 |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,350 % éch. 30/07/2033 | 25 300 | 22 234 |
| Union européenne 2,750 % éch. 04/12/2037 | 17 900 | 17 327 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 17 171 | 14 775 |
| Union européenne 3,375 % éch. 04/10/2038 | € 14 820 | 14 748 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % éch. 01/10/2053 | 14 300 | 14 237 |
| Union européenne 4,000 % éch. 04/04/2044 | 12 100 | 12 074 |
| BMW Finance NV 4,119 % éch. 09/12/2024 | 10 400 | 10 400 |
| Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,250 % éch. 20/04/2029 | 9 700 | 9 669 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | \$ 10 866 | 9 552 |
| Twin Bridges PLC 5,880 % éch. 12/09/2055 | £ 8 020 | 9 213 |
| Barclays PLC 5,829 % éch. 09/05/2027 | \$ 9 800 | 8 805 |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,550 % éch. 01/03/2039 | € 8 710 | 8 585 |
| UniCredit SpA 2,569 % éch. 22/09/2026 | \$ 9 100 | 7 771 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 1 583 400 | € 154 259 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,000 % éch. 31/01/2026 | € 78 400 | 72 162 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,750 % éch. 01/07/2024 | 49 800 | 49 196 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 392 712 | 37 100 |
| Obligation internationale du gouvernement français 2,500 % éch. 24/09/2026 | € 28 300 | 28 396 |
| | ACTIONS | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 292 500 | 28 388 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,450 % éch. 31/10/2027 | € 23 300 | 21 748 |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,400 % éch. 30/07/2028 | 19 200 | 17 729 |
| Union européenne 2,750 % éch. 04/12/2037 | 17 900 | 16 736 |
| Union européenne 0,250 % éch. 22/04/2036 | 23 000 | 16 386 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % éch. 15/11/2029 | 17 100 | 15 978 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % éch. 15/05/2028 | 14 447 | 14 360 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % éch. 15/09/2031 | 17 900 | 13 786 |
| Union européenne 4,000 % éch. 04/04/2044 | 12 100 | 12 390 |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,350 % éch. 30/07/2033 | 12 900 | 12 184 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,150 % éch. 01/09/2052 | 19 000 | 12 014 |
| Barclays PLC 3,125 % éch. 17/01/2024 | £ 8 700 | 10 012 |
| Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,250 % éch. 20/04/2029 | € 9 700 | 9 606 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % éch. 15/06/2029 | 11 100 | 9 311 |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2038 | 9 949 | 9 106 |
| Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmateral 0,010 % éch. 23/06/2028 | 10 500 | 8 919 |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,550 % éch. 01/03/2039 | 8 735 | 8 605 |

(a) Le Fonds Euro Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Credit Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Union européenne 0,000 % éch. 04/10/2030 | € 15 400 | € 12 406 |
| Banque européenne d'investissement 2,250 % éch. 15/03/2030 | 12 800 | 12 294 |
| Fonds européen de stabilité financière 3,000 % éch. 15/12/2028 | 11 000 | 10 940 |
| BNP Paribas S.A. 2,750 % éch. 25/07/2028 | 10 700 | 10 013 |
| Banque européenne d'investissement 0,050 % éch. 13/10/2034 | 12 700 | 9 141 |
| Union européenne 2,750 % éch. 04/02/2033 | 7 600 | 7 529 |
| Région d'Île de France 3,050 % éch. 03/02/2033 | 7 200 | 7 183 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 6,625 % éch. 27/09/2029 | 6 400 | 6 606 |
| Union européenne 0,000 % éch. 04/11/2025 | 6 700 | 6 204 |
| Union européenne 1,500 % éch. 04/10/2035 | 7 400 | 6 189 |
| Union européenne 0,400 % éch. 04/02/2037 | 8 900 | 6 130 |
| Mécanisme européen de stabilité 0,750 % éch. 15/03/2027 | 6 700 | 6 118 |
| Fonds européen de stabilité financière 1,250 % éch. 24/05/2033 | 7 000 | 6 103 |
| ING Groep NV 4,500 % éch. 23/05/2029 | 6 100 | 6 102 |
| Union européenne 0,450 % éch. 04/07/2041 | 9 700 | 6 092 |
| Fonds européen de stabilité financière 2,375 % éch. 11/04/2028 | 6 300 | 6 091 |
| Banque européenne d'investissement 0,250 % éch. 20/01/2032 | 7 500 | 6 088 |
| Association internationale de développement 1,750 % éch. 05/05/2037 | 7 400 | 6 024 |
| BNG Bank NV 3,000 % éch. 11/01/2033 | 6 000 | 5 997 |
| Union européenne 2,750 % éch. 04/12/2037 | 6 200 | 5 964 |
| BNG Bank NV 3,500 % éch. 27/09/2038 | 5 800 | 5 743 |
| UBS Group AG 7,750 % éch. 01/03/2029 | 5 100 | 5 697 |
| Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2023 | 5 600 | 5 588 |
| Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % éch. 18/11/2024 | 5 300 | 5 486 |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,000 % éch. 10/01/2030 | 5 100 | 5 078 |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,233 % éch. 25/04/2029 | 5 100 | 4 995 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------------|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 436 500 | € 42 821 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| UBS Group AG 1,250 % éch. 17/04/2025 | € 12 500 | 12 146 |
| Wells Fargo & Co. 1,000 % éch. 02/02/2027 | 12 100 | 10 889 |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 78 904 | 7 577 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | 74 128 | 7 479 |
| BNP Paribas S.A. 1,904 % éch. 30/09/2028 | \$ 9 000 | 7 020 |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % éch. 09/07/2027 | € 7 200 | 6 694 |
| Barclays PLC 0,577 % éch. 09/08/2029 | 8 300 | 6 670 |
| Nationwide Building Society 4,363 % éch. 01/08/2024 | \$ 6 800 | 6 300 |
| Union européenne 0,000 % éch. 04/11/2025 | € 6 700 | 6 297 |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,655 % éch. 22/08/2028 | \$ 7 100 | 6 275 |
| UBS Group AG 1,250 % éch. 17/07/2025 | € 6 900 | 6 238 |
| Banque européenne d'investissement 2,250 % éch. 15/03/2030 | 6 200 | 6 121 |
| BNG Bank NV 3,000 % éch. 10/01/2033 | 6 000 | 5 818 |
| Union européenne 2,750 % éch. 04/12/2037 | 6 200 | 5 738 |
| Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % éch. 05/09/2027 | 5 300 | 5 178 |
| Cooperatieve Rabobank UA 4,000 % éch. 10/01/2030 | 5 100 | 5 141 |
| Logicor Financing SARL 2,250 % éch. 13/05/2025 | 5 500 | 5 039 |
| BNP Paribas S.A. 0,500 % éch. 04/06/2026 | 5 400 | 5 021 |
| Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 0,625 % éch. 19/11/2027 | 5 700 | 4 886 |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 6,625 % éch. 27/09/2029 | 4 700 | 4 834 |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 4,715 % éch. 15/07/2030 | 4 887 | 4 810 |
| NatWest Group PLC 2,000 % éch. 04/03/2025 | 4 900 | 4 798 |

(a) Le Fonds Euro Credit Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Income Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Jupiter Mortgage PLC 6,621 % éch. 20/07/2060 | £ 24 700 | € 27 420 | Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2023 | € 21 750 | € 21 715 |
| Bridgegate Funding PLC 7,470 % éch. 16/10/2062 | 24 122 | 26 663 | Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % éch. 29/03/2028 | 21 600 | 19 218 |
| Dutch Property Finance BV 4,852 % éch. 28/04/2064 | € 16 200 | 15 995 | Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2053 | DKK 168 664 | 16 983 |
| Shamrock Residential DAC 4,876 % éch. 24/06/2071 | 15 000 | 14 787 | ACTIONS | | |
| Glenbeigh Issuer DAC 4,666 % éch. 24/06/2050 | 14 848 | 14 629 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 154 800 | 14 875 |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2023 | 14 600 | 14 550 | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| RMAC PLC 0,000 % éch. 15/02/2047 | £ 11 100 | 12 937 | HSBC Holdings PLC 1,589 % éch. 24/05/2027 | \$ 17 500 | 14 307 |
| SLM Student Loan Trust 6,252 % éch. 25/03/2026 | \$ 13 701 | 12 699 | Loxam S.A.S. 3,250 % éch. 14/01/2025 | € 14 600 | 13 966 |
| Barclays PLC 7,437 % éch. 02/11/2033 | 12 226 | 12 596 | Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026 | 13 600 | 13 148 |
| Tower Bridge Funding PLC 6,721 % éch. 20/10/2064 | £ 10 400 | 11 876 | Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % éch. 09/10/2025 | 14 000 | 13 108 |
| NatWest Group PLC 6,016 % éch. 02/03/2034 | \$ 12 200 | 11 509 | Banco de Sabadell S.A. 1,125 % éch. 27/03/2025 | 14 000 | 12 872 |
| BPCE S.A. 5,748 % éch. 19/07/2033 | 12 100 | 11 072 | Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027 | 14 200 | 12 616 |
| Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % éch. 15/01/2033 | 11 700 | 11 005 | Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 112 167 | 11 274 |
| HSBC Holdings PLC 5,402 % éch. 11/08/2033 | 12 000 | 10 902 | Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % éch. 15/01/2033 | \$ 11 700 | 10 992 |
| ABN AMRO Bank NV 6,575 % éch. 13/10/2026 | 11 200 | 10 636 | Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % éch. 17/03/2026 | € 11 400 | 10 717 |
| Twin Bridges PLC 6,432 % éch. 15/05/2056 | £ 9 100 | 10 435 | Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | 11 500 | 9 831 |
| Lloyds Banking Group PLC 4,750 % éch. 21/09/2031 | € 10 300 | 10 238 | Société Générale S.A. 2,226 % éch. 21/01/2026 | \$ 11 000 | 9 624 |
| Jupiter Mortgage PLC 7,721 % éch. 20/07/2060 | £ 8 760 | 10 131 | IHO Verwaltungen GmbH 3,625 % éch. 15/05/2025 | € 10 200 | 9 614 |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2024 | € 9 800 | 9 716 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % éch. 09/07/2027 | 10 500 | 9 562 |
| Avon Finance PLC 0,000 % éch. 28/12/2049 | £ 8 300 | 9 596 | Accor S.A. 2,375 % éch. 29/11/2028 | 9 600 | 8 237 |
| Pacific Gas & Electric Co. 6,950 % éch. 15/03/2034 | \$ 9 500 | 8 820 | TP ICAP Finance PLC 2,625 % éch. 18/11/2028 | £ 8 600 | 7 779 |
| Atrium Hotel Portfolio Trust 7,309 % éch. 15/06/2035 | 9 700 | 8 681 | Aroundtown S.A. 1,500 % éch. 28/05/2026 | € 9 000 | 7 774 |
| Nationwide Building Society 6,557 % éch. 18/10/2027 | 9 100 | 8 566 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 75 223 | 7 222 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | 9 259 | 8 135 | Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % éch. 15/02/2025 | \$ 7 700 | 6 689 |
| Standard Chartered PLC 6,750 % éch. 08/02/2028 | 8 500 | 8 038 | UBS Group AG 1,250 % éch. 17/07/2025 | € 7 000 | 6 682 |
| Shamrock Residential DAC 4,726 % éch. 24/01/2061 | € 7 913 | 7 874 | AerCap Ireland Capital DAC 3,150 % éch. 15/02/2024 | \$ 7 300 | 6 523 |
| Société Générale S.A. 6,446 % éch. 10/01/2029 | \$ 7 700 | 7 295 | Digital Intrepid Holding BV 1,375 % éch. 18/07/2032 | € 7 500 | 6 038 |
| Option One Mortgage Loan Trust 5,650 % éch. 25/04/2037 | 13 654 | 7 290 | WPC Eurobond BV 1,350 % éch. 15/04/2028 | 7 000 | 5 922 |
| Fieldstone Mortgage Investment Trust 6,250 % éch. 25/12/2035 | 9 291 | 7 247 | Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % éch. 13/09/2029 | 7 500 | 5 899 |
| UBS Commercial Mortgage Trust 6,909 % éch. 15/02/2032 | 7 520 | 6 700 | Sofina S.A. 1,000 % éch. 23/09/2028 | 7 400 | 5 819 |
| KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029 | 7 200 | 6 695 | Grifols S.A. 6,223 % éch. 15/11/2027 | 6 000 | 5 705 |
| UBS Group AG 7,750 % éch. 01/03/2029 | € 6 400 | 6 664 | Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,708 % éch. 22/06/2028 | \$ 5 670 | 5 170 |
| Mortimer BTL PLC 0,000 % éch. 22/12/2056 | £ 5 800 | 6 651 | Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,250 % éch. 22/03/2030 | € 6 000 | 5 141 |
| ACTIONS | | | KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029 | \$ 5 200 | 4 878 |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 66 500 | 6 533 | INEOS Finance PLC 6,593 % éch. 08/11/2028 | € 5 000 | 4 761 |
| VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | AA Bond Co. Ltd. 5,500 % éch. 31/07/2050 | £ 4 510 | 4 650 |
| Sandoz Finance BV 4,220 % éch. 17/04/2030 | € 6 500 | 6 498 | (a) Le Fonds Euro Income Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié. | | |
| UBS Group AG 6,246 % éch. 22/09/2029 | \$ 6 900 | 6 463 | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation. | | |
| AIB Group PLC 5,250 % éch. 23/10/2031 | € 6 380 | 6 351 | Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. | | |
| Harbour Energy PLC 6,120 % éch. 28/01/2054 | £ 5 700 | 6 300 | Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille. | | |
| Pacific Gas & Electric Co. 6,100 % éch. 15/01/2029 | \$ 6 800 | 6 283 | | | |

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Long Average Duration Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|--------------------------------------|--------------------|---|--------------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Obligation internationale du gouvernement français 4,500 % éch. 25/04/2041 | € 91 700 | € 107 923 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 624 900 | € 60 845 |
| | ACTIONS | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 957 700 | 93 326 | Obligation internationale du gouvernement français 3,250 % éch. 25/05/2045 | € 22 500 | 22 026 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052 | 40 900 | 21 004 |
| Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/10/2038 | € 58 800 | 64 827 | Obligation internationale du gouvernement belge 3,750 % éch. 22/06/2045 | 14 900 | 15 049 |
| Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2055 | 50 100 | 56 769 | Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/10/2038 | 14 200 | 14 666 |
| Obligation internationale du gouvernement français 3,250 % éch. 25/05/2045 | 55 400 | 54 868 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | \$ 12 564 | 11 665 |
| Obligation internationale du gouvernement français 3,000 % éch. 25/05/2054 | 56 100 | 52 411 | République d'Allemagne 4,750 % éch. 04/07/2040 | € 7 800 | 10 095 |
| Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2060 | 36 500 | 42 327 | République d'Allemagne 4,250 % éch. 04/07/2039 | 7 200 | 8 578 |
| Obligation internationale du gouvernement français 2,500 % éch. 25/05/2043 | 46 700 | 41 474 | République d'Allemagne 2,500 % éch. 15/08/2046 | 7 300 | 7 051 |
| Obligation internationale du gouvernement néerlandais 2,750 % éch. 15/01/2047 | 27 100 | 27 640 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % éch. 15/05/2028 | 6 852 | 6 807 |
| République d'Allemagne 4,750 % éch. 04/07/2040 | 21 100 | 26 758 | Obligation internationale du gouvernement français 2,500 % éch. 25/05/2043 | 7 600 | 6 516 |
| Obligation internationale du gouvernement belge 3,750 % éch. 22/06/2045 | 20 300 | 21 199 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b) | \$ 6 707 | 6 187 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b) | \$ 21 904 | 19 845 | Obligation internationale du gouvernement français 2,000 % éch. 25/05/2048 | € 6 450 | 4 951 |
| Obligation internationale du gouvernement néerlandais 0,000 % éch. 15/01/2038 | € 24 800 | 16 780 | Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/05/2072 | 12 100 | 4 414 |
| Obligation internationale du gouvernement néerlandais 0,000 % éch. 15/01/2052 | 32 000 | 15 652 | Union européenne 4,000 % éch. 04/04/2044 | 4 200 | 4 302 |
| Obligation internationale du gouvernement français 1,500 % éch. 25/05/2050 | 20 600 | 14 226 | Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2055 | 2 800 | 3 104 |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052 | 25 700 | 14 149 | République d'Allemagne 1,250 % éch. 15/08/2048 | 4 000 | 2 986 |
| République d'Allemagne 2,500 % éch. 04/07/2044 | 13 500 | 12 691 | Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 26 741 | 2 518 |
| Obligation internationale du gouvernement slovène 1,500 % éch. 25/03/2035 | 14 800 | 12 047 | Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/06/2039 | € 2 850 | 2 405 |
| Obligation internationale du gouvernement français 1,250 % éch. 25/05/2038 | 15 300 | 11 945 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026 | 2 400 | 2 373 |
| Obligation internationale du gouvernement français 2,000 % éch. 25/05/2048 | 14 800 | 11 653 | | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | \$ 12 474 | 11 248 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2053 | € 20 800 | 10 964 | | | |

(a) Le Fonds Euro Long Average Duration Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Short-Term Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (a) | \$ 14 211 | € 12 578 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % éch. 09/03/2026 | € 4 300 | 3 998 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 6,690 % éch. 20/02/2045 | £ 2 997 | 3 513 |
| Revocar UG 4,513 % éch. 21/04/2036 | € 2 711 | 2 716 |
| Union européenne 0,400 % éch. 04/02/2037 | 3 000 | 2 097 |
| Bank of Queensland Ltd. 1,839 % éch. 09/06/2027 | 2 000 | 1 863 |
| JAB Holdings BV 1,750 % éch. 25/06/2026 | 1 900 | 1 792 |
| Nordea Kredit Realkreditatieselskab 1,000 % éch. 01/10/2024 | DKK 13 500 | 1 762 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026 | € 1 700 | 1 691 |
| Bpifrance Financement S.A. 11,625 % éch. 01/11/2027 | 1 600 | 1 598 |
| Westpac Banking Corp. 3,457 % éch. 04/04/2025 | 1 500 | 1 500 |
| ING Bank NV 3,000 % éch. 15/02/2026 | 1 500 | 1 495 |
| Hana Bank 3,750 % éch. 04/05/2026 | 1 400 | 1 399 |
| Burberry Group PLC 1,125 % éch. 21/09/2025 | £ 1 100 | 1 150 |
| Heathrow Funding Ltd. 1,500 % éch. 12/10/2027 | € 1 200 | 1 143 |
| Fortum Oyj 1,625 % éch. 27/02/2026 | 1 200 | 1 138 |
| Thames Water Utilities Finance PLC 4,000 % éch. 19/06/2025 | £ 1 000 | 1 120 |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % éch. 29/05/2026 | € 1 200 | 1 109 |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,437 % éch. 04/04/2025 | 1 100 | 1 100 |
| Nationale-Nederlanden Bank NV 0,500 % éch. 10/10/2024 | 1 100 | 1 051 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (a) | \$ 14 396 | € 13 048 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,550 % éch. 06/11/2023 | € 7 300 | 7 183 |
| Bank of China Ltd. 5,216 % éch. 10/08/2023 | £ 5 000 | 5 616 |
| Korea Housing Finance Corp. 0,723 % éch. 22/03/2025 | € 5 700 | 5 427 |
| Trinity Square PLC 6,070 % éch. 15/07/2059 | £ 4 441 | 5 003 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 6,365 % éch. 20/10/2051 | 3 629 | 4 256 |
| Bain Capital Euro CLO DAC 4,733 % éch. 20/01/2032 | € 3 800 | 3 717 |
| Freddie Mac 0,800 % éch. 28/10/2026 | \$ 4 200 | 3 469 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % éch. 09/03/2026 | € 3 700 | 3 440 |
| BNZ International Funding Ltd. 0,625 % éch. 03/07/2025 | 3 600 | 3 389 |
| Freddie Mac 0,650 % éch. 27/10/2025 | \$ 3 900 | 3 313 |
| Precise Mortgage Funding PLC 6,420 % éch. 12/12/2055 | £ 2 804 | 3 243 |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0,250 % éch. 17/03/2025 | € 3 400 | 3 210 |
| Korea Housing Finance Corp. 0,010 % éch. 05/02/2025 | 3 300 | 3 113 |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % éch. 09/07/2024 | 3 200 | 3 113 |
| Yorkshire Building Society 0,125 % éch. 08/05/2024 | 3 100 | 3 023 |
| Toronto-Dominion Bank 1,707 % éch. 28/07/2025 | 3 100 | 2 985 |
| Becton Dickinson and Co. 0,000 % éch. 13/08/2023 | 3 000 | 2 970 |
| Caja Rural de Navarra SCC 0,625 % éch. 01/12/2023 | 3 000 | 2 952 |
| Schaeffler AG 1,875 % éch. 26/03/2024 | 3 000 | 2 934 |
| SEB S.A. 1,500 % éch. 31/05/2024 | 3 000 | 2 923 |
| Stratton Mortgage Funding PLC 6,121 % éch. 20/07/2060 | £ 2 492 | 2 894 |
| Jubilee Place BV 4,835 % éch. 17/01/2059 | € 2 899 | 2 884 |
| Canada Square Funding PLC 6,170 % éch. 17/06/2058 | £ 2 535 | 2 814 |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC 5,871 % éch. 20/07/2058 | 2 512 | 2 802 |
| Dexia Credit Local S.A. 0,250 % éch. 01/06/2023 | € 2 600 | 2 593 |
| Morgan Stanley 0,637 % éch. 26/07/2024 | 2 600 | 2 587 |
| Development Bank of Japan, Inc. 0,010 % éch. 15/10/2024 | 2 600 | 2 492 |
| Dell Bank International DAC 1,625 % éch. 24/06/2024 | 2 500 | 2 438 |

(a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|---|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 106 500 | € 10 368 | Rolls-Royce PLC 4,625 % éch. 16/02/2026 | € 4 700 | € 4 628 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % éch. 03/08/2027 | 4 150 | 4 071 |
| Obligation internationale du gouvernement français 4,250 % éch. 25/10/2023 | € 7 340 | 7 352 | Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % éch. 17/06/2031 | \$ 4 800 | 3 581 |
| Bons du Trésor du Mécanisme européen de stabilité 0,000 % éch. 23/05/2024 | 6 930 | 6 800 | Summer BC Holdco SARL 5,750 % éch. 31/10/2026 | € 2 800 | 2 458 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % éch. 03/08/2027 | 4 150 | 4 150 | Telefonica Europe BV 6,750 % éch. 31/12/2099 | 2 300 | 2 253 |
| Intesa Sanpaolo SpA 4,198 % éch. 01/06/2032 | \$ 5 800 | 4 082 | Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | 2 500 | 2 138 |
| AT&T, Inc. 2,875 % éch. 02/03/2025 | € 4 100 | 3 810 | Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % éch. 21/11/2033 | \$ 2 100 | 2 036 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % éch. 17/06/2031 | \$ 5 100 | 3 771 | Renault S.A. 2,375 % éch. 25/05/2026 | € 2 100 | 1 940 |
| Wintershall Dea Finance BV 2,499 % éch. 20/04/2026 | € 4 100 | 3 575 | | | |
| Grifols S.A. 3,200 % éch. 01/05/2025 | 3 700 | 3 560 | ACTIONS | | |
| Cirsa Finance International SARL 4,500 % éch. 15/03/2027 | 3 800 | 3 548 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 19 000 | 1 879 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % éch. 31/03/2027 | 3 800 | 3 241 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Telecom Italia SpA 7,875 % éch. 31/07/2028 | 3 200 | 3 215 | Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % éch. 15/08/2024 | € 1 900 | 1 865 |
| Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030 | £ 3 400 | 3 136 | Renault S.A. 1,125 % éch. 04/10/2027 | 2 200 | 1 865 |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2023 | € 3 090 | 3 078 | Lottomatica SpA 7,125 % éch. 01/06/2028 | 1 800 | 1 853 |
| EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031 | 4 300 | 3 076 | Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % éch. 08/06/2026 | 2 100 | 1 797 |
| Spectrum Brands, Inc. 4,000 % éch. 01/10/2026 | 3 200 | 3 068 | Cirsa Finance International SARL 4,750 % éch. 22/05/2025 | 1 800 | 1 761 |
| Pinnacle Bidco PLC 6,375 % éch. 15/02/2025 | £ 2 800 | 2 991 | Intrum AB 9,250 % éch. 15/03/2028 | 1 800 | 1 754 |
| Électricité de France S.A. 6,000 % éch. 29/01/2026 | 2 600 | 2 726 | Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2023 | 1 700 | 1 698 |
| Schaeffler AG 3,375 % éch. 12/10/2028 | € 2 900 | 2 599 | Rolls-Royce PLC 3,375 % éch. 18/06/2026 | £ 1 580 | 1 681 |
| Telecom Italia SpA 2,375 % éch. 12/10/2027 | 3 000 | 2 595 | EP Infrastructure A/S 1,698 % éch. 30/07/2026 | € 1 900 | 1 635 |
| | | | INEOS Quattro Finance Plc 3,375 % éch. 15/01/2026 | \$ 1 900 | 1 584 |
| | | | Synthomer PLC 3,875 % éch. 01/07/2025 | € 1 600 | 1 537 |
| | | | Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % éch. 15/07/2025 | 1 600 | 1 527 |
| | | | Volkswagen International Finance NV 7,500 % éch. 31/12/2099 | 1 400 | 1 432 |
| | | | Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026 | £ 1 300 | 1 407 |
| | | | Elior Group S.A. 3,750 % éch. 15/07/2026 | € 1 700 | 1 389 |
| | | | Accor S.A. 2,625 % éch. 30/01/2025 | 1 400 | 1 321 |
| | | | BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % éch. 30/11/2028 | 1 500 | 1 251 |
| | | | Inter Media and Communication SpA 6,750 % éch. 09/02/2027 | 1 300 | 1 225 |
| | | | WeBuild SpA 7,000 % éch. 28/09/2028 | 1 200 | 1 214 |
| | | | Obligation internationale du gouvernement français 4,250 % éch. 25/10/2023 | 1 200 | 1 200 |

(a) Le Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|--|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 213 500 | € 20 618 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 333 400 | € 32 263 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (b) | \$ 8 375 | 7 412 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 30 694 | 3 046 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % éch. 15/09/2024 | € 2 956 | 2 976 | Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | 31 521 | 2 999 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,100 % éch. 01/02/2029 | 2 800 | 2 879 | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 | 28 880 | 2 744 |
| Realkredit Danmark A/S 5,000 % éch. 01/10/2053 | DKK 20 800 | 2 785 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % éch. 09/07/2024 | € 2 400 | 2 342 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,000 % éch. 01/11/2023 | € 2 200 | 2 296 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,000 % éch. 01/11/2023 | 2 200 | 2 293 |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,350 % éch. 30/07/2033 | 1 600 | 1 461 | UniCredit SpA 7,830 % éch. 04/12/2023 | \$ 2 050 | 1 879 |
| République d'Allemagne 4,250 % éch. 04/07/2039 | 900 | 1 143 | Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 18 682 | 1 843 |
| Union européenne 4,000 % éch. 04/04/2044 | 1 100 | 1 098 | Realkredit Danmark A/S 2,000 % éch. 01/10/2053 | 17 500 | 1 840 |
| HSBC Holdings PLC 6,254 % éch. 09/03/2034 | \$ 1 000 | 944 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0,125 % éch. 15/09/2031 | € 2 300 | 1 831 |
| Union européenne 0,300 % éch. 04/11/2050 | € 1 900 | 897 | Realkredit Danmark A/S 3,000 % éch. 01/10/2053 | DKK 13 600 | 1 619 |
| AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % éch. 06/02/2027 | 900 | 897 | Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,350 % éch. 30/07/2033 | € 1 600 | 1 431 |
| Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025 | 900 | 873 | Crown European Holdings S.A. 2,625 % éch. 30/09/2024 | 1 400 | 1 374 |
| Société Générale SFH S.A. 3,625 % éch. 31/07/2026 | 800 | 799 | Deutsche Bank AG 2,625 % éch. 16/12/2024 | £ 1 200 | 1 311 |
| Santander UK Group Holdings PLC 6,534 % éch. 10/01/2029 | \$ 800 | 754 | Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025 | € 1 200 | 1 194 |
| Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/01/2046 | £ 1 100 | 716 | Volkswagen Bank GmbH 1,875 % éch. 31/01/2024 | 1 200 | 1 184 |
| Westpac Banking Corp. 3,457 % éch. 04/04/2025 | € 700 | 700 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (b) | \$ 1 287 | 1 146 |
| ING Belgium S.A. 3,375 % éch. 31/05/2027 | 700 | 699 | Union européenne 4,000 % éch. 04/04/2044 | € 1 100 | 1 128 |
| Barclays PLC 7,437 % éch. 02/11/2033 | \$ 600 | 606 | Sparebanken Soer Boligkredditt A/S 3,125 % éch. 14/11/2025 | 1 100 | 1 101 |
| Royal Bank of Canada 4,415 % éch. 17/01/2025 | € 600 | 600 | Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,205 % éch. 15/11/2024 | 1 100 | 1 099 |
| | | | République d'Allemagne 4,250 % éch. 04/07/2039 | 900 | 1 098 |
| | | | Charles Schwab Corp. 5,916 % éch. 13/05/2026 | \$ 1 200 | 1 086 |
| | | | Deutsche Bank AG 4,000 % éch. 29/11/2027 | € 1 100 | 1 082 |

(a) Le Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Advantage Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|---|--------------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 19 132 421 | \$ 190 536 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024 | ¥ 1 050 000 | 7 902 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | \$ 6 654 | 6 452 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/04/2023 | HUF 1 653 000 | 4 830 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 13/04/2023 | 1 647 000 | 4 747 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 4 200 | 4 415 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 30/11/2023 | HUF 1 538 000 | 4 374 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028 | CAD 5 500 | 4 134 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 4,250 % éch. 10/12/2032 | KRW 4 950 810 | 4 050 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 3 824 | 3 800 |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | 3 400 | 3 509 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/12/2033 | CAD 4 700 | 3 325 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b) | \$ 3 061 | 2 963 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 1,500 % éch. 20/09/2043 | ¥ 360 000 | 2 587 |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare 4,500 % éch. 27/01/2033 | € 2 100 | 2 219 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 4,500 % éch. 17/01/2033 | \$ 2 200 | 2 178 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033 | KRW 2 805 850 | 2 105 |
| Magyar Export-Import Bank 6,125 % éch. 04/12/2027 | \$ 2 100 | 2 084 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053 | CAD 3 750 | 2 077 |
| Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034 | \$ 1 900 | 1 886 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|--------------------------------------|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 19 149 288 | \$ 190 700 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028 | CAD 5 500 | 4 137 |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | \$ 3 400 | 3 512 |
| Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041 | 4 500 | 3 378 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,940 % éch. 12/02/2029 | PEN 9 000 | 2 157 |
| Obligation internationale du gouvernement bulgare 4,500 % éch. 27/01/2033 | € 2 100 | 2 143 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053 | CAD 3 750 | 1 965 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033 | 2 180 | 1 554 |
| Obligation internationale du gouvernement marocain 2,000 % éch. 30/09/2030 | € 1 800 | 1 530 |
| CIFC Funding Ltd. 6,657 % éch. 18/04/2031 | \$ 1 500 | 1 489 |
| UBS Group AG 4,703 % éch. 05/08/2027 | 1 500 | 1 457 |
| American Municipal Power, Inc. 7,334 % éch. 15/02/2028 | 1 300 | 1 411 |
| Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028 | 1 400 | 1 399 |
| Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % éch. 27/09/2023 | 1 400 | 1 383 |
| Obligation internationale du gouvernement serbe 3,125 % éch. 15/05/2027 | € 1 400 | 1 376 |
| LCM LP 6,717 % éch. 20/07/2031 | \$ 1 300 | 1 285 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033 | KRW 1 645 360 | 1 242 |
| Madison Park Funding Ltd. 6,405 % éch. 15/04/2029 | \$ 1 240 | 1 226 |
| Man GLG Euro CLO DAC 4,775 % éch. 15/10/2032 | € 1 099 | 1 165 |
| Citigroup, Inc. 3,785 % éch. 17/03/2033 | \$ 1 300 | 1 157 |

(a) Le Fonds Global Advantage Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 101 948 889 | \$ 1 015 250 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023 | ¥ 31 160 000 | 244 445 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028 | CAD 264 600 | 197 730 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031 | 223 959 | 148 531 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 4,250 % éch. 10/12/2032 | KRW 166 494 540 | 136 110 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024 | ¥ 17 912 450 | 134 182 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/08/2053 | \$ 135 000 | 132 620 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | 129 538 | 125 876 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/03/2024 | ¥ 15 550 000 | 120 544 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 109 000 | 114 574 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/09/2027 | CAD 143 300 | 106 280 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/09/2053 | \$ 104 990 | 106 262 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/12/2033 | CAD 145 600 | 103 006 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 92 408 | 91 612 |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | 88 200 | 91 022 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b) | 90 376 | 87 460 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,519 % éch. 20/04/2028 | MYR 394 244 | 84 194 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 1,500 % éch. 20/09/2043 | ¥ 11 670 000 | 83 876 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053 | CAD 149 130 | 83 867 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033 | KRW 102 355 980 | 76 910 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/10/2052 | \$ 81 537 | 75 058 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/09/2052 | 68 000 | 63 908 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/04/2024 | ¥ 8 140 000 | 62 516 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033 | CAD 79 050 | 56 296 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 87 617 069 | \$ 872 500 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028 | CAD 264 600 | 198 050 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031 | 223 959 | 148 630 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/09/2027 | 143 300 | 106 340 |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | \$ 88 200 | 91 067 |
| Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041 | 114 700 | 86 089 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053 | CAD 149 130 | 79 520 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033 | 79 050 | 56 360 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 452 587 | 47 103 |
| Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027 | € 46 300 | 47 084 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033 | KRW 52 310 460 | 39 490 |
| Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028 | \$ 35 400 | 35 386 |
| Boeing Co. 1,950 % éch. 01/02/2024 | 36 000 | 34 888 |
| CBAM Ltd. 6,797 % éch. 20/10/2029 | 27 151 | 26 947 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,450 % éch. 17/06/2043 | THB 793 970 | 25 139 |
| Enel Finance International NV 2,650 % éch. 10/09/2024 | \$ 25 800 | 24 810 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/06/2032 | CAD 36 310 | 23 562 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/12/2033 | 29 920 | 21 395 |
| Prudential Funding Asia PLC 2,950 % éch. 03/11/2033 | \$ 24 600 | 20 708 |
| Suci Second Investment Co. 6,250 % éch. 25/10/2033 | 19 700 | 20 057 |

(a) Le Fonds Global Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Bond ESG Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) |
|---|-------------------------------|--------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023 | ¥ 16 560 000 | \$ 129 911 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/04/2053 | \$ 51 995 | 51 858 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024 | ¥ 6 820 000 | 51 185 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/05/2053 | \$ 47 995 | 48 440 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/10/2052 | \$ 49 956 | 45 987 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031 | CAD 63 552 | 42 126 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 34 323 | 34 153 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/03/2024 | ¥ 4 110 000 | 31 831 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | \$ 31 387 | 30 523 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033 | KRW 36 353 420 | 27 444 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/12/2033 | CAD 36 800 | 26 035 |
| Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2023 | DKK 180 000 | 25 801 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033 | CAD 35 830 | 25 510 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/01/2053 | \$ 24 453 | 24 989 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028 | CAD 31 800 | 23 900 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 2,000 % éch. 10/06/2031 | KRW 34 358 800 | 23 680 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b) | \$ 24 374 | 23 595 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 1,500 % éch. 20/09/2043 | ¥ 3 270 000 | 23 503 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/04/2024 | DKK 160 400 | 22 889 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053 | \$ 21 826 | 22 365 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,519 % éch. 20/04/2028 | MYR 104 662 | 22 352 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053 | CAD 39 460 | 22 116 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 4,250 % éch. 10/12/2032 | KRW 26 799 020 | 21 926 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % éch. 30/10/2031 | € 20 000 | 21 914 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/06/2032 | CAD 32 600 | 21 300 |

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------|-----------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031 | CAD 63 552 | \$ 42 161 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033 | \$ 35 830 | 25 542 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028 | \$ 31 800 | 23 916 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053 | \$ 21 228 | 21 670 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/06/2032 | CAD 32 600 | 21 340 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053 | \$ 39 460 | 20 948 |
| Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 23/02/2028 | € 12 300 | 11 827 |
| Région d'Île de France 3,700 % éch. 14/06/2038 | \$ 10 000 | 10 840 |
| Agence Française de Développement 2,875 % éch. 21/01/2030 | \$ 9 000 | 9 644 |
| Communauté Française de Belgique 1,625 % éch. 03/05/2032 | \$ 10 300 | 9 247 |
| Morgan Stanley 3,622 % éch. 01/04/2031 | \$ 9 100 | 8 232 |
| Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028 | \$ 8 100 | 8 097 |
| Banque de développement asiatique 1,500 % éch. 04/05/2028 | CAD 11 700 | 7 854 |
| Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026 | £ 7 145 | 7 798 |
| Province de l'Ontario 1,550 % éch. 01/11/2029 | CAD 11 600 | 7 486 |
| Fannie Mae 6,500 % éch. 01/07/2053 | \$ 6 954 | 7 100 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 2,650 % éch. 21/10/2032 | \$ 8 300 | 6 805 |
| Région d'Île de France 3,050 % éch. 03/02/2033 | € 6 000 | 6 432 |
| Freddie Mac 6,500 % éch. 01/07/2053 | \$ 6 044 | 6 171 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023 | ILS 23 200 | 5 855 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,200 % éch. 20/09/2032 | ¥ 750 000 | 5 839 |
| ACTIONS | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (a) | \$ 580 000 | 5 788 |
| VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| LeasePlan Corp. NV 0,250 % éch. 23/02/2026 | € 5 800 | 5 652 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,450 % éch. 17/06/2043 | THB 177 900 | 5 624 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/12/2031 | CAD 8 500 | 5 460 |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2,875 % éch. 25/05/2027 | € 5 000 | 5 406 |
| Société Nationale SNCF S.A. 3,125 % éch. 02/11/2027 | \$ 5 000 | 5 374 |
| Fannie Mae 6,500 % éch. 01/08/2053 | \$ 5 209 | 5 318 |
| Région Wallonne Belgique 1,375 % éch. 06/04/2032 | € 6 000 | 5 244 |
| BNP Paribas S.A. 3,132 % éch. 20/01/2033 | \$ 6 300 | 5 174 |
| Deutsche Bank AG 3,961 % éch. 26/11/2025 | \$ 5 300 | 5 172 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 2,500 % éch. 01/01/2052 | \$ 5 819 | 5 019 |

(a) Le Fonds Global Bond ESG Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes de la Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Bond Ex-US Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 47 312 269 | \$ 471 153 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023 | ¥ 2 880 000 | 22 593 |
| Obligation internationale du gouvernement chinois 2,440 % éch. 15/10/2027 | CNY 149 740 | 21 921 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031 | CAD 24 958 | 16 215 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/04/2053 | \$ 11 703 | 10 967 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/10/2053 | 11 000 | 10 807 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024 | ¥ 1 320 000 | 9 878 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,519 % éch. 20/04/2028 | MYR 44 429 | 9 488 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 4,250 % éch. 10/12/2032 | KRW 10 509 430 | 8 589 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | \$ 8 259 | 8 024 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 7 200 | 7 568 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/12/2033 | CAD 9 100 | 6 438 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028 | 7 300 | 5 487 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033 | 7 670 | 5 472 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b) | \$ 5 487 | 5 312 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/04/2024 | ¥ 690 000 | 5 304 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 5 339 | 5 302 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033 | KRW 6 805 960 | 5 118 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 1,500 % éch. 20/09/2043 | ¥ 710 000 | 5 103 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/07/2053 | \$ 5 000 | 4 911 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 51 010 005 | \$ 508 000 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031 | CAD 24 958 | 16 228 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028 | 7 300 | 5 490 |
| Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033 | 7 670 | 5 476 |
| Obligation internationale du gouvernement chinois 3,810 % éch. 14/09/2050 | CNY 24 300 | 3 921 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053 | CAD 6 700 | 3 603 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/12/2051 | 6 150 | 3 455 |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,450 % éch. 17/06/2043 | THB 109 900 | 3 392 |
| Nordea Kredit Realkreditatieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 25 382 | 2 786 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC 4,685 % éch. 15/10/2031 | € 2 392 | 2 548 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033 | KRW 3 225 240 | 2 433 |
| Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,885 % éch. 15/08/2029 | MYR 10 179 | 2 175 |
| Oracle Corp. 2,300 % éch. 25/03/2028 | \$ 2 400 | 2 143 |
| Banco Santander S.A. 4,875 % éch. 18/10/2031 | € 1 900 | 2 002 |
| Boeing Co. 2,750 % éch. 01/02/2026 | \$ 2 100 | 1 980 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028 | PEN 7 900 | 1 954 |
| Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028 | \$ 1 800 | 1 799 |
| Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % éch. 27/09/2023 | 1 800 | 1 778 |
| Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027 | € 1 700 | 1 729 |
| Commerzbank AG 5,125 % éch. 18/01/2030 | 1 600 | 1 715 |

(a) Le Fonds Global Bond Ex-US Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global High Yield Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|--|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 85 721 928 | \$ 853 684 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 100 110 738 | \$ 997 000 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Billets du Trésor américain 5,000 % éch. 31/10/2025 | \$ 59 100 | 59 112 | Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/11/2027 | \$ 90 700 | 89 960 |
| EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031 | € 39 000 | 30 632 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/10/2027 | 78 000 | 76 746 |
| Électricité de France S.A. 9,125 % éch. 15/03/2033 | \$ 26 800 | 27 399 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 30/09/2027 | 20 000 | 20 048 |
| ZF Europe Finance BV 6,125 % éch. 13/03/2029 | € 17 900 | 19 224 | EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031 | € 19 500 | 14 747 |
| TIM SpA 7,875 % éch. 31/07/2023 | 16 850 | 18 321 | Sprint Capital Corp. 8,750 % éch. 15/03/2032 | \$ 10 000 | 12 236 |
| Las Vegas Sands Corp. 3,900 % éch. 08/08/2029 | \$ 20 500 | 17 831 | Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % éch. 15/07/2025 | € 10 000 | 10 694 |
| Cidron Aida Fincio SARL 5,000 % éch. 01/04/2028 | € 17 500 | 17 159 | Ctec GmbH 5,250 % éch. 15/02/2030 | 12 000 | 10 610 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % éch. 05/09/2027 | 15 300 | 16 768 | Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 3,750 % éch. 15/01/2025 | 10 000 | 10 320 |
| Harbour Energy PLC 5,500 % éch. 15/10/2026 | \$ 17 300 | 16 186 | Sprint LLC 7,625 % éch. 15/02/2025 | \$ 10 000 | 10 255 |
| Loarre Investments SARL 6,500 % éch. 15/05/2029 | € 15 500 | 16 146 | Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025 | 10 000 | 9 865 |
| United Group BV 3,625 % éch. 15/02/2028 | 17 330 | 14 710 | Mundys SpA 1,875 % éch. 13/07/2027 | € 10 000 | 9 735 |
| HAT Holdings LLC 8,000 % éch. 15/06/2027 | \$ 14 150 | 14 157 | TMNL Holding BV 3,750 % éch. 15/01/2029 | 10 000 | 9 485 |
| NCR Atleos Corp. 9,500 % éch. 01/04/2029 | 12 475 | 12 319 | Telefonica Europe BV 6,750 % éch. 31/12/2099 | 9 100 | 9 437 |
| Wintershall Dea Finance BV 2,499 % éch. 20/04/2026 | € 12 000 | 11 334 | Tenet Healthcare Corp. 6,125 % éch. 01/10/2028 | \$ 10 000 | 9 176 |
| Freedom Mortgage Corp. 12,000 % éch. 01/10/2028 | \$ 10 900 | 10 682 | UPCB Finance Ltd. 3,625 % éch. 15/06/2029 | € 9 500 | 8 905 |
| Cerba Healthcare SACA 3,500 % éch. 31/05/2028 | € 11 900 | 10 661 | Synthomer PLC 3,875 % éch. 01/07/2025 | 8 800 | 8 870 |
| Allegiant Travel Co. 7,250 % éch. 15/08/2027 | \$ 10 500 | 10 461 | American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 4,000 % éch. 15/01/2028 | \$ 10 000 | 8 863 |
| Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030 | £ 10 000 | 10 301 | Virgin Media Finance PLC 3,750 % éch. 15/07/2030 | € 10 000 | 8 789 |
| goeasy Ltd. 9,250 % éch. 01/12/2028 | \$ 10 300 | 10 300 | Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % éch. 30/06/2029 | 10 000 | 8 673 |

(a) Le Fonds Global High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Investment Grade Credit Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 59 502 112 | \$ 592 639 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | 99 833 | 96 362 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b) | 96 458 | 94 054 |
| Obligations du Trésor américain 2,750 % éch. 15/11/2047 | 105 800 | 82 567 |
| Wells Fargo & Co. 5,557 % éch. 25/07/2034 | 80 400 | 79 639 |
| Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 15/08/2033 | 69 700 | 66 011 |
| Obligations du Trésor américain 4,750 % éch. 15/11/2043 | 64 200 | 65 467 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien 4,750 % éch. 18/01/2028 | 52 000 | 51 820 |
| Obligation internationale du gouvernement australien 3,500 % éch. 21/12/2034 | AUD 77 700 | 47 469 |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030 | \$ 39 500 | 39 500 |
| Amgen, Inc. 5,600 % éch. 02/03/2043 | 36 650 | 36 540 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 35 179 | 34 082 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 6,484 % éch. 24/10/2029 | 31 500 | 31 500 |
| BPCE S.A. 6,714 % éch. 19/10/2029 | 30 000 | 30 000 |
| UnitedHealth Group, Inc. 5,875 % éch. 15/02/2053 | 25 000 | 27 431 |
| Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034 | 26 900 | 27 019 |
| NatWest Group PLC 6,016 % éch. 02/03/2034 | 25 900 | 25 900 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 | MXN 524 123 | 25 123 |
| Obligation internationale du gouvernement saoudien 4,875 % éch. 18/07/2033 | \$ 25 000 | 24 705 |
| Obligations du Trésor américain 4,375 % éch. 15/08/2043 | 25 400 | 23 871 |

| DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|--|--------------------------|
| VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 60 062 109 | \$ 598 200 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029 | \$ 203 940 | 199 437 |
| Obligations du Trésor américain 2,000 % éch. 15/11/2041 | 172 700 | 114 331 |
| Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051 | 164 371 | 106 542 |
| Obligations du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2052 | 130 500 | 105 970 |
| Obligations du Trésor américain 1,375 % éch. 15/11/2040 | 147 600 | 86 946 |
| Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041 | 110 467 | 72 563 |
| Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 15/08/2033 | 69 700 | 66 515 |
| Obligations du Trésor américain 1,750 % éch. 15/08/2041 | 80 982 | 51 446 |
| Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/02/2052 | 70 400 | 50 831 |
| Tencent Holdings Ltd. 3,975 % éch. 11/04/2029 | 42 750 | 39 795 |
| Obligations du Trésor américain 3,000 % éch. 15/02/2048 | 40 992 | 33 359 |
| Obligations du Trésor américain 3,000 % éch. 15/05/2045 | 32 398 | 25 254 |
| Obligations du Trésor américain 3,125 % éch. 15/05/2048 | 29 360 | 24 506 |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028 | PEN 98 387 | 24 496 |
| Aroundtown S.A. 5,375 % éch. 21/03/2029 | \$ 31 800 | 24 377 |
| Bevco Lux SARL 1,500 % éch. 16/09/2027 | € 23 000 | 22 536 |
| Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % éch. 11/01/2027 | 22 042 | 21 886 |
| Crown Castle, Inc. 4,450 % éch. 15/02/2026 | \$ 20 933 | 20 730 |
| MH Sub LLC 9,220 % éch. 13/09/2024 | 20 277 | 20 077 |

(a) Le Fonds Global Investment Grade Credit Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|--|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 31/05/2025 | \$ 46 300 | \$ 46 035 | Obligations du Trésor américain 1,750 % éch. 15/08/2041 | \$ 37 750 | \$ 26 484 |
| Obligations du Trésor américain 4,750 % éch. 15/11/2043 | 33 800 | 34 757 | Billets du Trésor américain 0,500 % éch. 30/11/2023 | 22 700 | 22 263 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/07/2053 | 19 852 | 19 145 | Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 15/10/2025 | 21 700 | 21 422 |
| Union européenne 2,750 % éch. 04/12/2037 | € 15 300 | 15 744 | Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 31/05/2025 | 15 500 | 15 302 |
| Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/05/2043 | \$ 16 200 | 15 710 | République d'Allemagne 0,000 % éch. 15/08/2031 | € 14 700 | 12 621 |
| BNG Bank NV 3,250 % éch. 29/08/2033 | € 14 000 | 15 242 | Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/07/2033 | £ 11 050 | 9 716 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (a) | \$ 12 566 | 11 887 | Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | \$ 8 900 | 8 840 |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | 10 900 | 11 402 | Nordea Bank Abp 1,500 % éch. 30/09/2026 | 7 600 | 6 641 |
| Morgan Stanley 3,875 % éch. 27/01/2026 | 11 743 | 11 390 | Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/05/2043 | 6 100 | 5 900 |
| Arkea Home Loans SFH S.A. 3,250 % éch. 01/08/2033 | € 9 900 | 10 524 | Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042 | 6 200 | 5 617 |
| Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % éch. 01/04/2033 | \$ 10 249 | 10 260 | Apple, Inc. 1,400 % éch. 05/08/2028 | 6 100 | 5 291 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/12/2052 | 9 993 | 9 686 | Enel Finance International NV 4,625 % éch. 15/06/2027 | 5 400 | 5 243 |
| UBS Group AG 4,194 % éch. 01/04/2031 | 10 350 | 9 242 | CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % éch. 01/04/2053 | 5 250 | 5 075 |
| Toronto-Dominion Bank 5,264 % éch. 11/12/2026 | 8 900 | 8 900 | Zoetis, Inc. 2,000 % éch. 15/05/2030 | 6 100 | 5 067 |
| Mizuho Financial Group, Inc. 3,170 % éch. 11/09/2027 | 9 301 | 8 594 | Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/05/2041 | 6 500 | 4 949 |
| Morgan Stanley 5,123 % éch. 01/02/2029 | 8 500 | 8 500 | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 4,150 % éch. 15/12/2032 | 5 100 | 4 834 |
| Hana Bank 3,750 % éch. 04/05/2026 | € 7 500 | 8 282 | Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % éch. 21/01/2032 | 5 100 | 4 425 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/05/2053 | \$ 8 513 | 8 216 | Obligation internationale du gouvernement israélien 4,500 % éch. 17/01/2033 | 4 400 | 4 237 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/05/2053 | 8 622 | 8 122 | Owens Corning 3,875 % éch. 01/06/2030 | 4 500 | 4 191 |
| AP Moller - Maersk A/S 5,875 % éch. 14/09/2033 | 7 701 | 7 670 | Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048 | 3 900 | 4 059 |

(a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Low Duration Real Return Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 44 222 266 | \$ 440 384 | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 45 419 585 | \$ 452 300 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/01/2029 (b) | \$ 63 076 | 61 016 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b) | \$ 62 081 | 60 566 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b) | 51 484 | 48 064 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | 51 844 | 50 961 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b) | 43 057 | 43 717 | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2026 | £ 34 928 | 42 190 |
| Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027 | £ 27 902 | 35 555 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b) | \$ 34 837 | 33 959 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,500 % éch. 15/05/2029 | € 32 706 | 34 758 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b) | 30 692 | 30 571 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/07/2028 (b) | \$ 35 666 | 34 516 | République d'Allemagne 0,500 % éch. 15/04/2030 | € 24 573 | 26 993 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | 35 175 | 33 944 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2026 (b) | \$ 26 720 | 25 271 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,125 % éch. 10/10/2028 | € 26 000 | 28 145 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 25 502 | 24 609 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/01/2027 (b) | \$ 27 604 | 26 376 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2026 (b) | 22 264 | 21 172 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % éch. 15/09/2024 | € 22 663 | 24 981 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/01/2027 (b) | 2 067 | 19 531 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2026 (b) | \$ 25 015 | 24 150 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | 19 844 | 19 084 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2026 (b) | 22 665 | 21 458 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/09/2052 | 19 599 | 18 806 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/09/2052 | 19 993 | 19 567 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2025 (b) | 19 026 | 18 112 |
| Obligation internationale du gouvernement français 1,850 % éch. 25/07/2027 | € 13 761 | 15 973 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b) | 17 942 | 16 952 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b) | \$ 15 257 | 14 989 | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2024 | £ 13 160 | 16 556 |
| Bon du Trésor britannique 1,625 % éch. 22/10/2028 | £ 13 300 | 14 757 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2023 (b) | \$ 15 350 | 15 273 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % éch. 15/05/2039 | € 11 147 | 11 975 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2026 (b) | 12 571 | 11 777 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % éch. 26/05/2025 | 11 357 | 11 881 | Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 22/10/2029 | £ 11 400 | 11 573 |
| Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 22/10/2029 | £ 11 400 | 11 544 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/01/2029 (b) | \$ 9 970 | 9 417 |

(a) Le Fonds Global Low Duration Real Return Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Real Return Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|--|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 60 392 629 | \$ 601 440 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 58 752 134 | \$ 585 100 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | \$ 99 122 | 91 288 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b) | \$ 68 906 | 68 858 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,125 % éch. 10/10/2028 | € 49 600 | 53 691 | Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031 | € 43 474 | 47 179 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,100 % éch. 01/02/2029 | 43 400 | 48 359 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | \$ 34 784 | 34 588 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % éch. 15/05/2039 | 40 068 | 43 047 | Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2032 | £ 23 576 | 32 480 |
| Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031 | 29 778 | 31 546 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | \$ 27 458 | 25 961 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 26 480 | 25 982 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b) | 27 776 | 24 511 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | 25 695 | 25 274 | Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 31/01/2029 | £ 22 500 | 23 404 |
| Obligation internationale du gouvernement français 1,800 % éch. 25/07/2040 | € 19 094 | 25 075 | Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 22/10/2029 | 20 000 | 21 141 |
| Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 31/01/2029 | £ 22 500 | 23 421 | Obligation internationale du gouvernement australien 3,000 % éch. 20/09/2025 | AUD 20 720 | 20 475 |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,600 % éch. 31/10/2029 | € 24 400 | 22 978 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,550 % éch. 04/10/2041 | € 16 901 | 19 055 |
| Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 22/10/2029 | £ 20 000 | 20 426 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b) | \$ 18 924 | 18 040 |
| Bon du Trésor britannique 0,625 % éch. 22/03/2045 | 16 400 | 20 327 | Union européenne 4,000 % éch. 04/04/2044 | € 16 200 | 17 805 |
| Union européenne 4,000 % éch. 04/04/2044 | € 16 200 | 17 131 | Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 173 918 | 17 741 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (b) | \$ 15 800 | 15 126 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2030 (b) | \$ 16 026 | 14 043 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b) | 16 730 | 14 535 | Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,450 % éch. 31/10/2027 | € 13 400 | 13 749 |
| Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2049 | £ 10 400 | 12 499 | Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2049 | £ 10 400 | 12 443 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b) | \$ 12 698 | 12 181 | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2044 | 11 238 | 12 436 |
| Bon du Trésor britannique 1,125 % éch. 22/11/2037 | £ 8 330 | 11 703 | Bon du Trésor britannique 0,625 % éch. 22/11/2042 | 8 825 | 11 159 |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2028 | ¥ 1 609 290 | 11 600 | Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2038 | € 9 945 | 9 741 |

(a) Le Fonds Global Real Return Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Income Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|--|----------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 796 525 561 | \$ 7 934 007 | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 824 628 360 | \$ 8 213 000 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/09/2053 | \$ 2 548 609 | 2 597 214 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/09/2053 | \$ 1 150 000 | 1 156 469 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | 875 339 | 819 576 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/06/2053 | 505 393 | 515 757 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | 818 633 | 788 997 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 3,500 % éch. 01/05/2052 | 450 387 | 417 289 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 739 900 | 777 734 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053 | 404 682 | 415 942 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | \$ 754 761 | 731 266 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/04/2053 | 369 447 | 369 533 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b) | 726 740 | 705 802 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053 | 357 415 | 366 585 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/06/2053 | 516 067 | 531 395 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053 | 306 222 | 312 838 |
| Billets du Trésor américain 0,625 % éch. 30/11/2027 | 542 910 | 471 290 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053 | 285 949 | 291 813 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/01/2053 | 43 846 | 444 736 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/05/2053 | 289 155 | 289 222 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053 | 418 948 | 431 590 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/03/2053 | 280 306 | 287 485 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/02/2053 | 416 026 | 423 907 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/04/2053 | 205 308 | 210 702 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/04/2053 | 387 906 | 396 475 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/08/2053 | 160 910 | 164 210 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053 | 366 898 | 377 741 | Boeing Co. 5,805 % éch. 01/05/2050 | 159 822 | 157 891 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053 | 315 667 | 324 820 | Obligation internationale du gouvernement russe 5,930 % éch. 24/04/2024 RUB | 18 336 201 | 137 644 |
| Ginnie Mae 5,500 % éch. 20/07/2053 | 318 773 | 318 076 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/03/2053 | \$ 122 966 | 125 490 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/02/2053 | 306 748 | 312 487 | Credit Suisse AG 5,500 % éch. 20/08/2026 | € 100 800 | 114 028 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053 | 293 980 | 303 083 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/03/2053 | \$ 109 694 | 111 944 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/06/2053 | 301 781 | 300 555 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/04/2053 | 108 700 | 108 726 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/03/2053 | 287 921 | 295 749 | Bank of Ireland Group PLC 7,500 % éch. 19/05/2025 | € 102 118 | 108 139 |

(a) Le Fonds Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds Income Fund II

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|--|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO | | |
| US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 8 955 611 | \$ 89 181 | US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 9 118 051 | \$ 90 800 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053 | \$ 5 550 | 5 741 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053 | \$ 5 244 | 5 407 |
| Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 31/12/2027 | 4 600 | 4 640 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/11/2032 | 4 200 | 4 462 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/04/2053 | 4 800 | 4 490 | Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 31/12/2027 | 3 000 | 3 064 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/03/2053 | 4 000 | 4 022 | Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/05/2025 | 2 500 | 2 453 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/10/2052 | 3 800 | 3 706 | Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 31/10/2029 | 1 700 | 1 729 |
| Great Hall Mortgages PLC 5,599 % éch. 18/06/2038 | £ 2 960 | 3 436 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/08/2053 | 1 485 | 1 514 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/03/2053 | \$ 3 100 | 2 915 | Stratton Mortgage Funding PLC 7,721 % éch. 30/07/2060 | £ 1 000 | 1 210 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 3,500 % éch. 01/02/2053 | 3 182 | 2 906 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/08/2053 | \$ 795 | 810 |
| Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/11/2032 | 2 400 | 2 513 | Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029 | 700 | 707 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/01/2053 | 2 479 | 2 470 | HSBC Holdings PLC 6,254 % éch. 09/03/2034 | 600 | 624 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | 2 603 | 2 335 | KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029 | 600 | 599 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/04/2053 | 1 798 | 1 829 | Eurosail PLC 4,165 % éch. 15/12/2044 | € 504 | 531 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b) | 1 794 | 1 742 | UniCredit SpA 3,875 % éch. 30/06/2027 | 500 | 382 |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026 | ZAR 30 200 | 1 729 | T-Mobile USA, Inc. 4,800 % éch. 15/07/2028 | \$ 300 | 287 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/08/2053 | \$ 1 500 | 1 532 | Glencore Funding LLC 4,000 % éch. 27/03/2027 | 300 | 286 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/08/2053 | 1 500 | 1 512 | Boeing Co. 5,150 % éch. 01/05/2030 | 300 | 284 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 1 483 | 1 433 | Imperial Brands Finance PLC 3,500 % éch. 26/07/2026 | 300 | 280 |
| Eurosail PLC 4,408 % éch. 13/03/2045 | € 1 500 | 1 349 | Intesa Sanpaolo SpA 5,875 % éch. 01/09/2031 | € 300 | 255 |
| Curzon Mortgages PLC 6,970 % éch. 28/07/2049 | £ 1 000 | 1 256 | Dryden Euro CLO DAC 4,775 % éch. 15/01/2032 | 239 | 251 |

(a) Le Fonds Income Fund II investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Inflation Multi-Asset Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|------------|-------------------------------------|---|------------|-------------------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 10 196 296 | \$ 101 542 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 13 986 612 | \$ 139 282 |
| Invesco Physical Gold ETC | | 22 562 | | | |
| | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 15 528 | 14 937 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | \$ 38 637 | 36 609 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | 9 336 | 8 847 | Invesco Physical Gold ETC | 93 781 | 17 687 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033 | € 6 158 | 5 442 | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) |
| Ginnie Mae 6,238 % éch. 20/01/2073 | \$ 4 000 | 4 000 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 15 686 | 14 753 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % éch. 26/05/2025 | € 3 751 | 3 924 | Invesco Physical Gold ETC | 61 717 | 11 536 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/08/2052 | \$ 2 986 | 2 635 | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b) | 2 626 | 2 614 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/02/2047 (b) | \$ 4 985 | 4 046 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | 1 951 | 1 927 | MRCD Mark Mortgage Trust 2,718 % éch. 15/12/2036 | 2 598 | 2 404 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | 1 419 | 1 320 | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 10/08/2031 | £ 1 920 | 2 228 |
| | ACTIONS | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/02/2045 (b) | \$ 2 675 | 2 212 |
| Prologis, Inc. | 9 840 | 1 180 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | 2 047 | 2 035 |
| Equinix, Inc. | 1 363 | 973 | | | |
| | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053 | DKK 18 420 | 2 033 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b) | \$ 798 | 679 | Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | 16 500 | 1 766 |
| | ACTIONS | | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b) | \$ 1 850 | 1 528 |
| Public Storage | 2 041 | 595 | Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 22/03/2050 | £ 1 462 | 1 324 |
| Realty Income Corp. | 9 346 | 589 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b) | \$ 1 332 | 1 310 |
| | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | Bon du Trésor britannique 0,250 % éch. 22/03/2052 | £ 1 398 | 1 149 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/09/2052 | \$ 592 | 562 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/01/2029 (b) | \$ 1 205 | 1 148 |
| | ACTIONS | | Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050 | DKK 9 000 | 964 |
| Simon Property Group, Inc. | 5 099 | 555 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b) | \$ 738 | 696 |
| | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b) | 772 | 647 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b) | \$ 506 | 513 | | | |
| | ACTIONS | | | | |
| Invitation Homes, Inc. | 13 911 | 432 | | | |

(a) Le Fonds Inflation Multi-Asset Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Low Average Duration Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------------|-----------------------|--|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | |
| | | | | | |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 31/12/2024 | \$ 183 100 | 183 157 | Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 31/01/2024 | \$ 246 600 | 238 128 |
| Billets du Trésor américain 0,375 % éch. 31/01/2026 | 139 800 | 127 362 | Billets du Trésor américain 1,500 % éch. 29/02/2024 | 190 000 | 183 439 |
| Billets du Trésor américain 5,000 % éch. 31/08/2025 | 47 600 | 47 729 | Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 31/12/2024 | 117 800 | 116 300 |
| Billets du Trésor américain 5,000 % éch. 30/09/2025 | 42 000 | 41 966 | Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 31/10/2024 | 88 200 | 87 570 |
| Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 15/01/2026 | 42 000 | 41 846 | Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 15/01/2026 | 42 000 | 41 467 |
| Billets du Trésor américain 4,750 % éch. 31/07/2025 | 39 300 | 39 154 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/01/2025 | 38 500 | 38 219 |
| Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/01/2025 | 38 500 | 38 285 | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/01/2024 | BRL 68 300 | 14 032 |
| Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 30/11/2028 | 31 200 | 31 339 | HSBC Holdings PLC 6,161 % éch. 09/03/2029 | \$ 5 200 | 5 283 |
| Billets du Trésor américain 4,875 % éch. 30/11/2025 | 27 600 | 27 687 | JPMorgan Chase & Co. 4,851 % éch. 25/07/2028 | 4 300 | 4 284 |
| Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 15/08/2026 | 26 200 | 26 006 | Mercedes-Benz Finance North America LLC 5,500 % éch. 27/11/2024 | 3 900 | 3 936 |
| Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 31/05/2025 | 27 900 | 25 815 | Philip Morris International, Inc. 5,125 % éch. 15/11/2024 | 3 900 | 3 909 |
| Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 31/05/2025 | 19 800 | 19 753 | UBS Group AG 4,488 % éch. 12/05/2026 | 4 000 | 3 908 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/01/2024 | BRL 93 000 | 17 939 | Global Payments, Inc. 4,950 % éch. 15/08/2027 | 3 800 | 3 719 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/07/2024 | 71 800 | 14 035 | ABN AMRO Bank NV 2,375 % éch. 01/06/2027 | € 3 600 | 3 694 |
| Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026 | € 6 700 | 7 155 | Reliance Steel & Aluminum Co. 1,300 % éch. 15/08/2025 | \$ 3 900 | 3 569 |
| HSBC Holdings PLC 6,161 % éch. 09/03/2029 | \$ 5 200 | 5 200 | Banco Santander S.A. 3,892 % éch. 24/05/2024 | 3 600 | 3 545 |
| Ginnie Mae 6,438 % éch. 20/05/2073 | 4 325 | 4 323 | Bank of America Corp. 6,233 % éch. 23/07/2024 | 3 500 | 3 500 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % éch. 31/03/2027 | € 3 400 | 3 651 | UBS Group AG 5,711 % éch. 12/01/2027 | 3 500 | 3 477 |
| Freddie Mac 3,590 % éch. 25/01/2025 | \$ 3 604 | 3 532 | HSBC Holdings PLC 2,999 % éch. 10/03/2026 | 3 600 | 3 395 |

(a) Le Fonds Low Average Duration Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|--|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 43 335 970 | \$ 431 579 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 41 770 222 | \$ 416 000 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/01/2025 | \$ 41 600 | 41 459 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/01/2025 | \$ 27 900 | 27 552 |
| Billets du Trésor américain 5,000 % éch. 31/08/2025 | 26 000 | 26 009 | Billets du Trésor américain 5,000 % éch. 31/08/2025 | 26 000 | 25 941 |
| Obligation internationale du gouvernement australien 2,750 % éch. 21/11/2028 | AUD 41 600 | 25 922 | Obligation internationale du gouvernement canadien 3,750 % éch. 01/05/2025 | CAD 31 600 | 22 854 |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 3,750 % éch. 01/05/2025 | CAD 31 600 | 23 357 | Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 15/10/2025 | \$ 20 900 | 20 604 |
| Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 15/08/2026 | \$ 20 700 | 20 587 | Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 15/08/2026 | 20 700 | 20 497 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | 18 492 | 18 165 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | 18 729 | 18 623 |
| Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 31/03/2025 | 16 500 | 16 504 | Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 31/03/2025 | 16 500 | 16 160 |
| Billets du Trésor américain 4,750 % éch. 31/07/2025 | 15 600 | 15 555 | Billets du Trésor américain 4,750 % éch. 31/07/2025 | 15 600 | 15 515 |
| Union européenne 2,000 % éch. 04/10/2027 | € 12 200 | 12 912 | Billets du Trésor américain 2,250 % éch. 31/03/2024 | 12 100 | 11 767 |
| Wells Fargo & Co. 5,574 % éch. 25/07/2029 | \$ 8 400 | 8 400 | Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025 | 6 700 | 6 505 |
| Bon du Trésor britannique 1,625 % éch. 22/10/2028 | £ 7 200 | 7 851 | Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 15/12/2025 | 6 100 | 6 002 |
| République d'Allemagne 2,500 % éch. 13/03/2025 | € 6 700 | 7 148 | Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 31/10/2024 | 6 000 | 5 949 |
| Barclays PLC 7,285 % éch. 13/09/2027 | \$ 6 500 | 6 500 | Billets du Trésor américain 4,500 % éch. 15/11/2025 | 5 100 | 5 068 |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,000 % éch. 03/12/2026 | MXN 126 457 | 6 351 | SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026 | 3 900 | 3 890 |
| MassMutual Global Funding 6,344 % éch. 10/07/2026 | \$ 6 000 | 6 000 | Société Générale S.A. 4,677 % éch. 15/06/2027 | 3 500 | 3 391 |
| Marriott International, Inc. 5,550 % éch. 15/10/2028 | 5 500 | 5 469 | Ford Motor Credit Co. LLC 6,860 % éch. 05/06/2026 | £ 2 500 | 3 115 |
| Toronto-Dominion Bank 3,765 % éch. 08/09/2026 | € 5 000 | 5 415 | China Construction Bank Europe S.A. 0,000 % éch. 28/06/2024 | € 2 800 | 2 949 |
| JPMorgan Chase & Co. 5,299 % éch. 24/07/2029 | \$ 5 200 | 5 200 | Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026 | 2 700 | 2 844 |
| CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,200 % éch. 01/10/2028 | 5 200 | 5 194 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % éch. 09/07/2024 | 2 600 | 2 690 |

(a) Le Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Low Duration Income Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|---|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 21 264 905 | \$ 211 821 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 11 957 291 | \$ 119 116 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Shamrock Residential DAC 4,726 % éch. 24/01/2061 | € 23 831 | 25 327 | Dufry One BV 3,625 % éch. 15/04/2026 | CHF 7 394 | 7 836 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | \$ 22 515 | 21 773 | Uber Technologies, Inc. 7,500 % éch. 15/05/2025 | \$ 7 600 | 7 714 |
| Tower Bridge Funding PLC 0,000 % éch. 20/01/2066 | £ 16 000 | 20 268 | INEOS Finance PLC 7,463 % éch. 08/11/2027 | € 7 059 | 7 534 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b) | \$ 20 475 | 19 900 | American Airlines, Inc. 5,500 % éch. 20/04/2026 | \$ 6 948 | 6 805 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 18 600 | 19 551 | Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % éch. 15/04/2025 | 4 404 | 4 404 |
| Canterbury Finance PLC 6,046 % éch. 16/05/2058 | £ 13 370 | 16 150 | Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % éch. 01/01/2026 | 4 474 | 4 162 |
| Jupiter Mortgage PLC 6,621 % éch. 20/07/2060 | 13 201 | 16 077 | Sprint LLC 7,125 % éch. 15/06/2024 | 4 098 | 4 153 |
| BPCE S.A. 6,612 % éch. 19/10/2027 | \$ 15 900 | 15 900 | Petco Health & Wellness Co., Inc. 1,000 % éch. 03/03/2028 | 3 767 | 3 738 |
| RMAC PLC 0,000 % éch. 15/02/2047 | £ 12 300 | 15 347 | ONEOK, Inc. 5,550 % éch. 01/11/2026 | 3 400 | 3 366 |
| SLM Student Loan Trust 6,252 % éch. 25/03/2026 | \$ 15 408 | 15 220 | Bombardier, Inc. 7,500 % éch. 15/03/2025 | 3 108 | 3 108 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | 15 298 | 14 671 | SkyMiles IP Ltd. 9,166 % éch. 20/10/2027 | 2 992 | 3 100 |
| Shamrock Residential DAC 4,876 % éch. 24/06/2071 | € 14 000 | 14 549 | Rolls-Royce PLC 4,625 % éch. 16/02/2026 | € 2 900 | 2 975 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | \$ 14 640 | 14 106 | Sandoz Finance BV 3,970 % éch. 17/04/2027 | 2 600 | 2 948 |
| Nationwide Building Society 6,557 % éch. 18/10/2027 | 14 000 | 14 000 | Energy Transfer LP 6,050 % éch. 01/12/2026 | \$ 2 700 | 2 745 |
| Twin Bridges PLC 6,432 % éch. 15/05/2056 | £ 10 900 | 13 393 | Uber Technologies, Inc. 8,000 % éch. 01/11/2026 | 2 585 | 2 646 |
| Dutch Property Finance BV 4,852 % éch. 28/04/2064 | € 12 400 | 13 348 | Amgen, Inc. 5,150 % éch. 02/03/2028 | 2 600 | 2 644 |
| Shamrock Residential DAC 5,126 % éch. 24/02/2071 | 12 335 | 13 233 | Wynn Macau Ltd. 5,625 % éch. 26/08/2028 | 2 700 | 2 331 |
| ABN AMRO Bank NV 6,575 % éch. 13/10/2026 | \$ 13 200 | 13 200 | VOC Escrow Ltd. 5,000 % éch. 15/02/2028 | 2 600 | 2 294 |
| Ginnie Mae 5,500 % éch. 20/07/2053 | 13 074 | 13 046 | UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024 | 2 280 | 2 259 |
| Harbour Energy PLC 6,120 % éch. 28/01/2054 | £ 10 800 | 12 739 | (a) Le Fonds Low Duration Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié. | | |
| Nelnet Student Loan Trust 5,910 % éch. 27/09/2066 | \$ 12 646 | 12 571 | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation. | | |
| Twin Bridges PLC 6,170 % éch. 14/06/2055 | £ 10 000 | 12 427 | Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. | | |
| Atlas Funding PLC 6,348 % éch. 20/01/2061 | 10 000 | 12 399 | Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille. | | |
| Kinbane DAC 4,685 % éch. 25/09/2062 | € 11 522 | 12 268 | | | |
| Avon Finance PLC 0,000 % éch. 28/12/2049 | £ 9 200 | 11 422 | | | |
| Ginnie Mae 5,500 % éch. 20/08/2053 | \$ 11 400 | 11 375 | | | |

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Low Duration Opportunities Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|--|-----------------------|--|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | |
| | | | | | |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | \$ 18 005 | 16 466 | Billets du Trésor américain 2,125 % éch. 30/09/2024 | \$ 73 200 | 71 005 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/01/2024 | BRL 83 000 | 16 341 | Billets du Trésor américain 1,250 % éch. 31/08/2024 | 37 300 | 36 000 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b) | \$ 16 426 | 15 548 | Billets du Trésor américain 1,750 % éch. 30/06/2024 | 21 600 | 20 930 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | 15 401 | 14 932 | Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/01/2024 | BRL 61 000 | 12 532 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/04/2023 | HUF 4 500 000 | 13 149 | Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026 | € 8 000 | 8 773 |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 13/04/2023 | 4 484 000 | 12 922 | Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028 | PEN 29 700 | 7 351 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % éch. 01/07/2024 | BRL 64 100 | 12 530 | | ACTIONS | |
| Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 30/11/2023 | HUF 3 007 000 | 8 552 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a) | 71 100 | 7 076 |
| Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026 | € 8 000 | 8 543 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | 3 300 | 3 469 | Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,940 % éch. 12/02/2029 | PEN 27 500 | 6 597 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % éch. 31/03/2027 | 3 200 | 3 436 | Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026 | £ 5 200 | 5 309 |
| Billets du Trésor américain 2,125 % éch. 30/09/2024 | \$ 3 200 | 3 097 | Sculptor European CLO DAC 4,755 % éch. 14/01/2032 | € 5 000 | 5 258 |
| Santander UK Group Holdings PLC 7,482 % éch. 29/08/2029 | £ 2 400 | 3 056 | Aurium CLO DAC 4,966 % éch. 23/03/2032 | 5 000 | 5 210 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026 | € 2 600 | 2 816 | Southern California Edison Co. 2,750 % éch. 01/02/2032 | \$ 5 900 | 5 034 |
| Virginia Electric and Power Co. 3,750 % éch. 15/05/2027 | \$ 2 900 | 2 789 | Aurium CLO DAC 4,695 % éch. 16/01/2031 | € 4 691 | 4 874 |
| Barclays PLC 6,496 % éch. 13/09/2027 | 2 500 | 2 500 | Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % éch. 17/09/2030 | \$ 5 400 | 4 850 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 4,223 % éch. 01/05/2029 | 2 500 | 2 371 | Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % éch. 09/03/2027 | 5 627 | 4 657 |
| BPCE S.A. 4,625 % éch. 12/09/2028 | 2 500 | 2 352 | Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027 | 4 700 | 4 291 |
| HSBC Holdings PLC 6,254 % éch. 09/03/2034 | 2 100 | 2 106 | Lazard Group LLC 4,500 % éch. 19/09/2028 | 4 000 | 3 852 |
| | | | Sasol Financing USA LLC 5,875 % éch. 27/03/2024 | 3 700 | 3 659 |
| | | | Volkswagen Financial Services NV 1,125 % éch. 18/09/2023 | £ 3 100 | 3 597 |

(a) Le Fonds Low Duration Opportunities Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/10/2053 | \$ 992 | \$ 946 | Weyerhaeuser Co. 3,375 % éch. 09/03/2033 | \$ 36 | \$ 31 |
| Billets du Trésor américain 5,000 % éch. 30/09/2025 | 400 | 399 | VeriSign, Inc. 2,700 % éch. 15/06/2031 | 30 | 25 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/05/2053 | 399 | 380 | CommScope, Inc. 8,720 % éch. 06/04/2026 | 20 | 19 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,500 % éch. 09/03/2028 | 200 | 200 | U.S. Foods, Inc. 7,970 % éch. 22/11/2028 | 16 | 16 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (a) | 101 | 98 | CenturyLink, Inc. 7,720 % éch. 15/03/2027 | 20 | 15 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (a) | 103 | 98 | Lumen Technologies, Inc. 4,000 % éch. 15/02/2027 | 18 | 12 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/08/2053 | 99 | 97 | (a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation. | | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (a) | 106 | 97 | Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/10/2053 | 100 | 94 | Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille. | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/07/2053 | 100 | 92 | | | |
| JPMorgan Chase & Co. 6,070 % éch. 22/10/2027 | 50 | 50 | | | |
| Weyerhaeuser Co. 4,750 % éch. 15/05/2026 | 36 | 36 | | | |
| New York State Electric & Gas Corp. 5,650 % éch. 15/08/2028 | 30 | 30 | | | |
| Toronto-Dominion Bank 5,264 % éch. 11/12/2026 | 20 | 20 | | | |
| AES Corp. 5,450 % éch. 01/06/2028 | 20 | 20 | | | |

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|---------|-----------------------|---|---------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Kinder Morgan, Inc. | 235 000 | \$ 4 154 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 492 065 | \$ 4 900 |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 273 548 | 2 724 | Pioneer Natural Resources Co. | 19 200 | 4 577 |
| Diamondback Energy, Inc. | 13 000 | 1 943 | Equitrans Midstream Corp. | 492 882 | 4 511 |
| ONEOK, Inc. | 26 900 | 1 784 | Pembina Pipeline Corp. | 128 600 | 4 063 |
| Antero Midstream Corp. | 129 400 | 1 411 | Enbridge, Inc. | 92 200 | 3 455 |
| EnLink Midstream LLC | 96 800 | 1 192 | Cheniere Energy, Inc. | 19 100 | 3 171 |
| Devon Energy Corp. | 19 700 | 1 001 | TC Energy Corp. | 73 720 | 2 831 |
| Antero Resources Corp. | 37 700 | 986 | ConocoPhillips Co. | 19 000 | 2 165 |
| Hess Midstream LP « A » | 33 800 | 948 | Targa Resources Corp. | 24 700 | 1 960 |
| Marathon Oil Corp. | 16 000 | 428 | DTE Midstream LLC | 30 000 | 1 566 |
| Pioneer Natural Resources Co. | 1 800 | 420 | Chesapeake Energy Corp. | 19 000 | 1 544 |
| EQT Corp. | 3 500 | 146 | Williams Cos., Inc. | 47 700 | 1 533 |
| Occidental Petroleum Corp. | 2 300 | 142 | Devon Energy Corp. | 30 200 | 1 486 |
| Chesapeake Energy Corp. | 800 | 68 | EOG Resources, Inc. | 8 700 | 1 119 |
| | | | Diamondback Energy, Inc. | 7 800 | 1 070 |
| | | | EnLink Midstream LLC | 67 500 | 844 |
| | | | ONEOK, Inc. | 13 400 | 792 |
| | | | Hess Midstream LP « A » | 24 690 | 742 |
| | | | EQT Corp. | 20 600 | 726 |
| | | | Antero Resources Corp. | 26 400 | 704 |

(a) Le Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Mortgage Opportunities Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------------|-----------------------|--|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/01/2053 | \$ 198 308 | 201 259 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/01/2053 | \$ 198 308 | \$ 200 349 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/03/2053 | 198 454 | 190 027 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/03/2053 | 197 704 | 193 854 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/10/2052 | 193 733 | 189 987 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/10/2052 | 193 733 | 185 568 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/05/2053 | 109 386 | 109 767 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/05/2053 | 108 295 | 108 145 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/07/2053 | 99 667 | 97 927 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/07/2053 | 99 467 | 99 750 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/04/2053 | 98 975 | 96 876 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/07/2053 | 99 667 | 96 632 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/01/2053 | 98 116 | 96 035 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/12/2052 | 99 248 | 94 999 |
| Fannie Mae 4,500 % éch. 01/10/2052 | 97 237 | 95 357 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/04/2053 | 98 820 | 94 906 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/08/2053 | 94 694 | 91 739 | Fannie Mae 4,500 % éch. 01/10/2052 | 97 237 | 93 138 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/08/2053 | 94 427 | 91 480 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/08/2053 | 94 694 | 92 123 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/05/2053 | 93 787 | 88 222 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/08/2053 | 94 427 | 91 863 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/02/2053 | 74 655 | 75 696 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/01/2053 | 97 057 | 91 264 |
| Freddie Mac 4,500 % éch. 01/01/2053 | 74 876 | 73 569 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/05/2053 | 93 787 | 86 859 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/07/2053 | 48 628 | 48 828 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/02/2053 | 74 655 | 75 424 |
| Fannie Mae 5,500 % éch. 01/06/2053 | 48 783 | 48 297 | Freddie Mac 4,500 % éch. 01/01/2053 | 74 876 | 73 347 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/03/2053 | 49 662 | 47 553 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/07/2053 | 48 628 | 48 380 |
| Ginnie Mae 6,238 % éch. 20/08/2073 | 43 443 | 43 303 | Fannie Mae 5,500 % éch. 01/06/2053 | 48 783 | 47 733 |
| Ginnie Mae 6,238 % éch. 20/07/2073 | 28 012 | 27 898 | Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/03/2053 | 48 787 | 46 065 |
| Fannie Mae 3,000 % éch. 25/10/2052 | 146 437 | 24 429 | Fannie Mae 3,000 % éch. 01/06/2051 | 21 807 | 20 043 |
| Ginnie Mae 6,238 % éch. 20/08/2073 | 17 460 | 17 373 | Fannie Mae 3,000 % éch. 01/06/2051 | 21 386 | 19 656 |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds StocksPLUS™ Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|--|-----------------------|---|--|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 14 532 012 | \$ 144 724 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 5 873 660 | \$ 58 500 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b) | \$ 32 755 | 31 891 | Ripon Mortgages PLC 5,920 % éch. 28/08/2056 | £ 12 228 | 14 381 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | 29 764 | 28 673 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 6,565 % éch. 25/04/2036 | \$ 11 300 | 10 622 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 23 701 | 22 855 | Taurus FR DAC 4,787 % éch. 22/12/2030 | € 7 079 | 7 500 |
| Primrose Residential DAC 4,626 % éch. 24/03/2061 | € 16 246 | 17 549 | Stratton Mortgage Funding PLC 5,920 % éch. 12/12/2043 | £ 5 578 | 6 521 |
| LT Autorahoitus DAC 4,534 % éch. 18/07/2033 | 15 249 | 16 554 | Logicor Financing SARL 2,250 % éch. 13/05/2025 | € 6 000 | 5 851 |
| Bumper FR 4,576 % éch. 27/04/2032 | 14 200 | 15 378 | Quanta Services, Inc. 0,950 % éch. 01/10/2024 | \$ 6 300 | 5 813 |
| Jupiter Mortgage PLC 6,021 % éch. 20/07/2060 | £ 11 540 | 14 424 | Frost CMBS DAC 5,152 % éch. 20/11/2033 | € 4 870 | 4 967 |
| LT Autorahoitus DAC 4,744 % éch. 18/12/2032 | € 12 869 | 14 113 | Aroundtown S.A. 5,375 % éch. 21/03/2029 | \$ 6 500 | 4 696 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC 5,938 % éch. 12/04/2032 | 12 960 | 13 918 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,440 % éch. 25/10/2047 | 5 400 | 4 686 |
| Silver Arrow Athlon NL BV 4,576 % éch. 26/04/2031 | 12 757 | 13 805 | Hyatt Hotels Corp. 1,800 % éch. 01/10/2024 | 4 600 | 4 321 |
| Hill FL BV 4,604 % éch. 18/05/2031 | 12 500 | 13 592 | Park Place Securities, Inc. 6,080 % éch. 25/05/2035 | 4 326 | 3 899 |
| MidOcean Credit CLO 6,794 % éch. 21/04/2031 | \$ 12 444 | 12 428 | Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 17/02/2032 | € 5 000 | 3 864 |
| Driver UK Multi-Compartment S.A. 5,847 % éch. 25/04/2031 | £ 9 400 | 11 599 | Broadcom, Inc. 4,000 % éch. 15/04/2029 | \$ 4 000 | 3 757 |
| Citibank N.A. 5,864 % éch. 29/09/2025 | \$ 11 200 | 11 211 | Nomura Resecuritization Trust 6,370 % éch. 25/03/2037 | 3 691 | 3 567 |
| Billets du Trésor américain 0,625 % éch. 30/11/2027 | 12 800 | 11 112 | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,750 % éch. 25/12/2046 | 3 353 | 3 068 |
| Tower Bridge Funding PLC 6,120 % éch. 21/07/2064 | £ 7 994 | 10 073 | RAMP Series Trust 5,510 % éch. 25/08/2046 | 3 188 | 2 879 |
| Red & Black Auto Germany 4,283 % éch. 15/09/2032 | € 9 400 | 10 066 | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 6,130 % éch. 25/07/2036 | 3 200 | 2 845 |
| Avon Finance PLC 0,000 % éch. 28/12/2049 | £ 8 100 | 10 056 | Option One Mortgage Loan Trust 5,600 % éch. 25/07/2037 | 4 220 | 2 767 |
| Freddie Mac 3,000 % éch. 01/11/2032 | \$ 10 574 | 9 742 | Long Beach Mortgage Loan Trust 6,385 % éch. 25/08/2035 | 3 000 | 2 674 |
| | | | Countrywide Alternative Loan Trust 5,662 % éch. 20/09/2046 | 2 718 | 2 636 |
| | | | Home Equity Asset Trust 5,450 % éch. 25/01/2037 | 2 936 | 2 525 |
| | | | European Loan Conduit DAC 4,994 % éch. 17/02/2030 | € 2 293 | 2 427 |
| | | | Jackson National Life Global Funding 6,242 % éch. 28/06/2024 | \$ 2 200 | 2 203 |
| | | | Dutch Property Finance BV 5,202 % éch. 28/04/2050 | € 2 093 | 2 195 |
| | | | Fremont Home Loan Trust 6,085 % éch. 25/11/2035 | \$ 2 400 | 2 085 |
| | | | 245 Park Avenue Trust 3,508 % éch. 05/06/2037 | 2 300 | 2 037 |
| | | | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,320 % éch. 25/03/2035 | 2 100 | 1 906 |

(a) Le Fonds StocksPLUS™ Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | |
| | | | | | |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | \$ 388 | 374 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/02/2044 (b) | \$ 128 | 127 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/07/2053 | 306 | 295 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | 103 | 97 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b) | 307 | 292 | VICI Properties LP 3,750 % éch. 15/02/2027 | 100 | 92 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/09/2052 | 201 | 191 | 245 Park Avenue Trust 3,508 % éch. 05/06/2037 | 100 | 89 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/10/2053 | 176 | 152 | Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % éch. 15/03/2032 | 100 | 88 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 119 | 114 | Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053 | DKK 71 | 8 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/09/2053 | 125 | 107 | | | |
| Palmer Square European Loan Funding DAC 5,602 % éch. 15/11/2032 | € 100 | 106 | (a) Le Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund investit dans des actions d'un fonds affilié. | | |
| Bank of America N.A. 5,650 % éch. 18/08/2025 | \$ 100 | 100 | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation. | | |
| Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 4,200 % éch. 15/07/2046 | 100 | 100 | Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées. | | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/08/2053 | 99 | 97 | Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille. | | |
| CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,504 % éch. 15/06/2057 | 100 | 96 | | | |
| WFRBS Commercial Mortgage Trust 3,073 % éch. 15/06/2046 | 81 | 81 | | | |
| Freddie Mac 3,458 % éch. 25/08/2023 | 17 | 17 | | | |
| Nykredit Realkredit A/S 2,464 % éch. 01/10/2023 | DKK 100 | 15 | | | |
| Nykredit Realkredit A/S 3,501 % éch. 01/10/2023 | 100 | 15 | | | |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % éch. 27/11/2031 | MXN 157 | 8 | | | |

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Strategic Income Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 20 696 661 | \$ 206 101 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 23 658 557 | \$ 235 600 |
| Johnson & Johnson | 26 139 | 4 297 | Johnson & Johnson | 28 695 | 4 900 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Avon Finance PLC 0,000 % éch. 28/12/2049 | £ 3 100 | 3 849 | INEOS Finance PLC 7,463 % éch. 08/11/2027 | € 4 307 | 4 591 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/07/2033 (b) | \$ 4 029 | 3 770 | Broadcom, Inc. | ACTIONS 4 263 | 3 875 |
| Obligation internationale du gouvernement israélien 5,000 % éch. 30/10/2026 | € 3 500 | 3 679 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| UBS Group AG 5,959 % éch. 12/01/2034 | \$ 3 458 | 3 463 | GLP Capital LP 4,000 % éch. 15/01/2031 | \$ 3 748 | 3 316 |
| Nelnet Student Loan Trust 5,910 % éch. 27/09/2066 | 3 329 | 3 310 | Community Health Systems, Inc. 5,625 % éch. 15/03/2027 | 3 611 | 3 121 |
| | ACTIONS | | | ACTIONS | |
| Coca-Cola Co. | 53 447 | 3 227 | Philip Morris International, Inc. | 31 021 | 2 893 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | Merck & Co., Inc. | 25 938 | 2 848 |
| SLM Student Loan Trust 6,252 % éch. 25/03/2026 | \$ 3 162 | 3 123 | BHP Group Ltd. | 81 053 | 2 400 |
| Man GLG Euro CLO DAC 5,779 % éch. 15/10/2036 | € 2 880 | 3 040 | Rio Tinto PLC | 34 217 | 2 260 |
| | ACTIONS | | Novartis AG | 22 839 | 2 243 |
| AbbVie, Inc. | 17 810 | 2 560 | General Dynamics Corp. | 9 607 | 2 225 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | Iberdrola S.A. | 166 615 | 2 125 |
| Primrose Residential DAC 4,876 % éch. 24/10/2061 | € 2 149 | 2 270 | KDDI Corp. | 65 000 | 2 055 |
| | ACTIONS | | Exxon Mobil Corp. | 18 871 | 2 025 |
| Phillips 66 | 21 092 | 2 204 | American International Group, Inc. | 31 339 | 1 922 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | Phillips 66 | 19 251 | 1 873 |
| Ginnie Mae 4,500 % éch. 20/06/2041 | \$ 2 141 | 2 070 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 2 097 | 2 023 | Amgen, Inc. 5,250 % éch. 02/03/2033 | \$ 1 800 | 1 857 |
| | ACTIONS | | | ACTIONS | |
| Verizon Communications, Inc. | 57 824 | 2 005 | Amgen, Inc. | 7 188 | 1 833 |
| Microsoft Corp. | 6 029 | 1 964 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Amgen, Inc. | 7 620 | 1 817 | Pacific Gas & Electric Co. 3,500 % éch. 15/06/2025 | \$ 1 891 | 1 801 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | | |
| Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034 | \$ 1 800 | 1 806 | (a) Le Fonds Strategic Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié. | | |
| Amgen, Inc. 5,250 % éch. 02/03/2033 | 1 800 | 1 794 | (b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation. | | |

(a) Le Fonds Strategic Income Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Total Return Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | |
| | | | | | |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/04/2053 | \$ 62 864 | 62 714 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | \$ 70 669 | 70 118 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % éch. 15/05/2028 | € 44 063 | 47 081 | Obligations du Trésor américain 3,625 % éch. 15/02/2053 | 27 300 | 26 208 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/05/2053 | \$ 40 982 | 41 034 | Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032 | 25 000 | 23 683 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b) | 38 037 | 37 206 | Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052 | 19 400 | 19 796 |
| Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/05/2043 | 38 100 | 37 083 | CPI Property Group S.A. 2,750 % éch. 12/05/2026 | € 20 200 | 18 092 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/06/2053 | 34 340 | 34 377 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % éch. 15/01/2026 | 15 000 | 15 832 |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052 | 30 800 | 33 069 | Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 28/02/2027 | \$ 16 700 | 15 716 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/02/2051 (b) | 47 510 | 28 266 | Obligations du Trésor américain 1,375 % éch. 15/08/2050 | 26 000 | 14 853 |
| Obligations du Trésor américain 3,625 % éch. 15/02/2053 | 27 300 | 27 414 | Obligations du Trésor américain 2,000 % éch. 15/02/2050 | 21 700 | 13 830 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 21 480 | 20 693 | Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | 13 175 | 13 817 |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/05/2053 | 20 000 | 19 916 | Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/06/2032 | CAD 18 800 | 12 228 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b) | 20 742 | 19 841 | Logicor Financing SARL 2,250 % éch. 13/05/2025 | € 11 000 | 10 930 |
| Nykredit Realkredit A/S 3,700 % éch. 01/10/2023 | DKK 126 000 | 19 011 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b) | \$ 12 504 | 10 822 |
| Obligations du Trésor américain 4,375 % éch. 15/08/2043 | \$ 18 000 | 17 696 | Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042 | 11 300 | 10 519 |
| Ginnie Mae 6,238 % éch. 20/01/2073 | 17 000 | 16 983 | Goldman Sachs Group, Inc. 5,700 % éch. 01/11/2024 | 9 900 | 10 017 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/02/2045 (b) | 19 203 | 16 026 | Prologis International Funding S.A. 3,125 % éch. 01/06/2031 | € 10 000 | 9 978 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b) | 14 905 | 14 374 | Deutsche Bank AG 1,000 % éch. 19/11/2025 | 10 000 | 9 937 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b) | 14 434 | 13 780 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,125 % éch. 04/09/2026 | 12 600 | 9 567 |
| JDE Peet's NV 4,125 % éch. 23/01/2030 | € 12 500 | 13 656 | Obligation internationale du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/12/2033 | CAD 12 200 | 8 724 |

(a) Le Fonds Total Return Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|----------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 19 924 454 | \$ 198 407 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 20 847 720 | \$ 207 600 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a) | 201 340 | 20 003 |
| Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023 | ¥ 3 784 000 | 29 685 | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Aries Capital DAC 0,000 % éch. 18/09/2030 | \$ 15 185 | 15 100 | CPPIB Capital, Inc. 6,338 % éch. 11/03/2026 | \$ 11 000 | 11 238 |
| Greenleaves Capital Designated Activity Co. 0,000 % éch. 18/09/2030 | 15 185 | 15 100 | Federal Home Loan Bank 5,370 % éch. 21/05/2024 | 8 500 | 8 499 |
| CPPIB Capital, Inc. 6,338 % éch. 11/03/2026 | 11 000 | 11 240 | Svensk Exportkredit AB 6,402 % éch. 23/02/2024 | 8 000 | 8 049 |
| | ACTIONS | | Federal Home Loan Bank 5,350 % éch. 17/05/2024 | 8 000 | 7 998 |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a) | 110 400 | 11 003 | Banque internationale pour la reconstruction et le développement 5,732 % éch. 18/09/2025 | 6 000 | 6 014 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | Morgan Stanley 5,519 % éch. 25/01/2024 | 4 500 | 4 494 |
| Federal Home Loan Bank 5,370 % éch. 21/05/2024 | \$ 8 500 | 8 500 | ORIX Corp. 4,050 % éch. 16/01/2024 | 4 500 | 4 463 |
| Svensk Exportkredit AB 6,402 % éch. 23/02/2024 | 8 000 | 8 065 | Freddie Mac 5,375 % éch. 24/04/2025 | 4 300 | 4 300 |
| Federal Home Loan Bank 5,350 % éch. 17/05/2024 | 8 000 | 8 000 | Toyota Motor Credit Corp. 5,569 % éch. 10/01/2025 | 4 200 | 4 200 |
| Banque internationale pour la reconstruction et le développement 5,732 % éch. 18/09/2025 | 6 000 | 6 015 | Federal Home Loan Bank 5,640 % éch. 16/09/2024 | 4 000 | 4 000 |
| Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,795 % éch. 15/07/2031 | 5 996 | 5 939 | Federal Home Loan Bank 5,360 % éch. 10/05/2024 | 4 000 | 3 994 |
| Morgan Stanley 5,519 % éch. 25/01/2024 | 4 500 | 4 497 | NXP BV 4,875 % éch. 01/03/2024 | 3 800 | 3 784 |
| Freddie Mac 5,375 % éch. 24/04/2025 | 4 300 | 4 300 | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,850 % éch. 25/03/2024 | 3 700 | 3 558 |
| Toyota Motor Credit Corp. 5,569 % éch. 10/01/2025 | 4 200 | 4 200 | National Bank of Canada 5,880 % éch. 06/08/2024 | 3 500 | 3 497 |
| Transpower New Zealand Ltd. 5,750 % éch. 28/08/2023 | AUD 6 000 | 4 159 | Bank of Montreal 5,682 % éch. 09/07/2024 | 3 435 | 3 428 |
| Federal Home Loan Bank 5,640 % éch. 16/09/2024 | \$ 4 000 | 4 000 | HCA, Inc. 5,000 % éch. 15/03/2024 | 3 100 | 3 092 |
| Federal Home Loan Bank 5,360 % éch. 10/05/2024 | 4 000 | 4 000 | CPPIB Capital, Inc. 6,604 % éch. 04/04/2025 | 3 000 | 3 038 |
| Bank of America Corp. 3,550 % éch. 05/03/2024 | 4 000 | 3 994 | VMware LLC 1,000 % éch. 15/08/2024 | 3 000 | 2 876 |
| RELX Capital, Inc. 3,500 % éch. 16/03/2023 | 4 000 | 3 992 | | | |
| Eni SpA 4,000 % éch. 12/09/2023 | 4 000 | 3 973 | | | |

(a) Le Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds UK Corporate Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-----------|-----------------------|---|--------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a) | | | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 31/01/2023 | £ 47 450 | £ 47 365 |
| | 245 300 | £ 24 997 | Billets du Trésor américain 3,250 % éch. 31/08/2024 | \$ 23 400 | 18 728 |
| | | | | ACTIONS | |
| | | | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a) | 118 800 | 12 096 |
| | | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Billets du Trésor américain 3,250 % éch. 31/08/2024 | \$ 25 200 | 19 863 | Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/03/2036 | £ 10 500 | 10 323 |
| Bon du Trésor britannique 1,625 % éch. 22/10/2028 | £ 17 700 | 15 897 | Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2049 | 4 600 | 4 922 |
| Bon du Trésor britannique 3,500 % éch. 22/10/2025 | 14 900 | 14 650 | Bon du Trésor britannique 1,625 % éch. 22/10/2028 | 5 300 | 4 644 |
| Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 30/01/2026 | 14 100 | 12 761 | Bon du Trésor britannique 3,500 % éch. 22/10/2025 | 4 400 | 4 344 |
| Bon du Trésor britannique 3,750 % éch. 22/10/2053 | 11 000 | 9 632 | UBS Group AG 7,375 % éch. 07/09/2033 | 3 200 | 3 287 |
| Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2049 | 4 600 | 4 754 | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 30/01/2026 | 3 100 | 2 815 |
| Lloyds Banking Group PLC 2,000 % éch. 12/04/2028 | 3 900 | 3 409 | Bon du Trésor britannique 4,500 % éch. 07/06/2028 | 2 400 | 2 415 |
| NRW Bank 5,375 % éch. 22/07/2026 | 2 800 | 2 792 | HSBC Holdings PLC 3,000 % éch. 22/07/2028 | 2 500 | 2 224 |
| Barclays PLC 7,090 % éch. 06/11/2029 | 2 650 | 2 670 | Virgin Money UK PLC 4,000 % éch. 25/09/2026 | 2 350 | 2 198 |
| Banque de développement asiatique 6,125 % éch. 15/08/2025 | 2 550 | 2 546 | Barclays PLC 3,250 % éch. 17/01/2033 | 2 600 | 2 043 |
| Barclays PLC 6,369 % éch. 31/01/2031 | 2 400 | 2 403 | Bon du Trésor britannique 4,500 % éch. 07/09/2034 | 2 000 | 2 023 |
| Bon du Trésor britannique 4,500 % éch. 07/06/2028 | 2 400 | 2 362 | Union européenne 0,000 % éch. 04/10/2028 | € 2 400 | 1 809 |
| Volkswagen Financial Services NV 5,875 % éch. 23/05/2029 | 2 100 | 2 104 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 4,125 % éch. 18/02/2026 | £ 1 800 | 1 761 |
| Bon du Trésor britannique 4,500 % éch. 07/09/2034 | 2 000 | 1 968 | Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % éch. 29/11/2035 | 1 800 | 1 738 |
| EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031 | € 3 100 | 1 924 | CPI Property Group S.A. 2,750 % éch. 22/01/2028 | 2 450 | 1 706 |
| Credit Suisse AG 7,750 % éch. 10/03/2026 | £ 1 900 | 1 897 | Heathrow Funding Ltd. 2,750 % éch. 09/08/2051 | 2 700 | 1 549 |
| Union européenne 0,000 % éch. 04/10/2028 | € 2 400 | 1 803 | Morgan Stanley 5,789 % éch. 18/11/2033 | 1 500 | 1 454 |
| Santander UK Group Holdings PLC 7,482 % éch. 29/08/2029 | £ 1 800 | 1 799 | | | |
| Weir Group PLC 6,875 % éch. 14/06/2028 | 1 800 | 1 796 | | | |

(a) Le Fonds UK Corporate Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------|--------------------|---|-------------------------------|-----------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 31/07/2051 | £ 25 300 | £ 14 813 | Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 31/01/2023 | £ 5 060 | £ 5 054 |
| Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2049 | 3 900 | 4 031 | Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2049 | 3 900 | 4 223 |
| Lloyds Bank PLC 6,500 % éch. 17/09/2040 | 3 700 | 3 917 | Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 31/07/2051 | 7 400 | 3 648 |
| SNCF Réseau 4,830 % éch. 25/03/2060 | 3 160 | 3 059 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % éch. 15/09/2026 | 3 400 | 3 047 |
| Bon du Trésor britannique 3,750 % éch. 22/10/2053 | 2 800 | 2 615 | Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 22/12/2028 | 3 600 | 2 982 |
| British Telecommunications PLC 5,750 % éch. 13/02/2041 | 2 500 | 2 372 | Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2046 | 2 600 | 2 477 |
| Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % éch. 23/05/2041 | 2 050 | 2 187 | GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % éch. 18/01/2033 | 2 500 | 2 461 |
| National Grid Electricity Transmission PLC 5,272 % éch. 18/01/2043 | 2 000 | 2 000 | Bon du Trésor britannique 1,500 % éch. 22/07/2047 | 3 800 | 2 194 |
| Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % éch. 28/05/2037 | 2 700 | 1 864 | Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/03/2036 | 1 900 | 1 962 |
| Walmart, Inc. 5,250 % éch. 28/09/2035 | 1 800 | 1 856 | Banque européenne d'investissement 6,000 % éch. 07/12/2028 | 1 700 | 1 877 |
| Électricité de France S.A. 5,625 % éch. 25/01/2053 | 1 900 | 1 846 | Oracle Corp. 6,900 % éch. 09/11/2052 | \$ 1 900 | 1 639 |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % éch. 27/02/2035 | 1 800 | 1 785 | Bon du Trésor britannique 3,500 % éch. 22/01/2045 | £ 1 900 | 1 635 |
| National Gas Transmission PLC 5,750 % éch. 05/04/2035 | 1 850 | 1 778 | Crédit Agricole S.A. 4,875 % éch. 23/10/2029 | 1 600 | 1 596 |
| BG Energy Capital PLC 5,000 % éch. 04/11/2036 | 1 800 | 1 698 | Barclays PLC 3,250 % éch. 17/01/2033 | 2 030 | 1 582 |
| United Utilities Water Finance PLC 5,750 % éch. 26/06/2036 | 1 700 | 1 693 | Lloyds Banking Group PLC 6,625 % éch. 02/06/2033 | 1 600 | 1 565 |
| Optivo Finance PLC 2,857 % éch. 07/10/2035 | 2 200 | 1 626 | E.ON International Finance BV 4,750 % éch. 31/01/2034 | 1 700 | 1 519 |
| Crédit Agricole S.A. 4,875 % éch. 23/10/2029 | 1 600 | 1 589 | United Utilities Water Finance PLC 2,000 % éch. 03/07/2033 | 1 700 | 1 266 |
| Lloyds Banking Group PLC 6,625 % éch. 02/06/2033 | 1 600 | 1 548 | Holcim Sterling Finance Netherlands BV 2,250 % éch. 04/04/2034 | 1 800 | 1 259 |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,750 % éch. 10/09/2042 | 1 800 | 1 509 | Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % | € 1 481 | 1 237 |
| Walmart, Inc. 5,625 % éch. 27/03/2034 | 1 400 | 1 496 | Annington Funding PLC 2,308 % éch. 06/10/2032 | £ 1 600 | 1 146 |
| Pfizer, Inc. 2,735 % éch. 15/06/2043 | 2 000 | 1 402 | | | |
| Tesco Property Finance PLC 5,411 % éch. 13/07/2044 | 1 449 | 1 365 | | | |
| Comcast Corp. 1,875 % éch. 20/02/2036 | 1 900 | 1 335 | | | |

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds US High Yield Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 84 245 388 | \$ 838 969 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 82 932 278 | \$ 825 900 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 31/01/2028 | \$ 25 000 | 24 384 | Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/11/2027 | \$ 50 700 | 49 840 |
| | ACTIONS | | Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025 | 50 000 | 48 854 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (a) | 1 743 573 | 20 021 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 30/09/2027 | 25 000 | 24 669 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 31/01/2028 | 25 000 | 23 802 |
| Las Vegas Sands Corp. 3,900 % éch. 08/08/2029 | \$ 15 275 | 13 303 | Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 31/08/2027 | 25 000 | 23 757 |
| TIM SpA 7,875 % éch. 31/07/2023 | € 11 400 | 12 395 | Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 15/10/2025 | 23 000 | 22 700 |
| Venture Global LNG, Inc. 8,375 % éch. 01/06/2031 | \$ 10 800 | 10 772 | Medline Borrower LP 5,250 % éch. 01/10/2029 | 14 200 | 12 455 |
| Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 31/12/2027 | 10 000 | 10 149 | Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 31/12/2027 | 10 000 | 9 668 |
| GN Bondco LLC 9,500 % éch. 15/10/2031 | 9 875 | 9 678 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/10/2027 | 9 000 | 9 006 |
| Trident TPI Holdings, Inc. 12,750 % éch. 31/12/2028 | 9 750 | 9 647 | Sprint Capital Corp. 8,750 % éch. 15/03/2032 | 7 000 | 8 565 |
| Medline Borrower LP 5,250 % éch. 01/10/2029 | 10 750 | 9 297 | McAfee Corp. 7,375 % éch. 15/02/2030 | 10 000 | 8 272 |
| TransDigm, Inc. 4,625 % éch. 15/01/2029 | 10 400 | 9 240 | Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028 | € 8 750 | 8 229 |
| Cerba Healthcare SACA 3,500 % éch. 31/05/2028 | € 9 900 | 9 100 | Heartland Dental LLC 8,500 % éch. 01/05/2026 | \$ 9 000 | 8 010 |
| Grifols S.A. 4,750 % éch. 15/10/2028 | \$ 9 675 | 8 354 | Sigma Holdco BV 7,875 % éch. 15/05/2026 | 8 000 | 6 679 |
| Intesa Sanpaolo SpA 9,125 % éch. 07/09/2029 | € 7 500 | 8 153 | Team Health Holdings, Inc. 6,375 % éch. 01/02/2025 | 12 000 | 6 621 |
| HAT Holdings LLC 8,000 % éch. 15/06/2027 | \$ 7 850 | 7 850 | Ford Motor Credit Co. LLC 2,900 % éch. 10/02/2029 | 8 000 | 6 558 |
| MajorDrive Holdings LLC 6,375 % éch. 01/06/2029 | 9 475 | 7 653 | LBM Acquisition LLC 6,250 % éch. 15/01/2029 | 8 000 | 6 319 |
| Bausch & Lomb Escrow Corp. 8,375 % éch. 01/10/2028 | 7 225 | 7 276 | Global Medical Response, Inc. 6,500 % éch. 01/10/2025 | 10 000 | 6 050 |
| American Airlines, Inc. 5,750 % éch. 20/04/2029 | 7 475 | 7 098 | White Cap Buyer LLC 6,875 % éch. 15/10/2028 | 6 800 | 6 001 |
| Freedom Mortgage Corp. 12,000 % éch. 01/10/2028 | 7 225 | 7 081 | | | |
| Triumph Group, Inc. 9,000 % éch. 15/03/2028 | 6 950 | 6 986 | | | |

(a) Le Fonds US High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | ACTIONS | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | ACTIONS | PRODUIT (en milliers) |
|--|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 12 646 991 | \$ 125 957 | PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 14 700 227 | \$ 146 400 |
| | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | | VALEUR NOMINALE (en milliers) | |
| Obligations du Trésor américain 2,500 % éch. 15/02/2046 | \$ 15 900 | 11 760 | Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | \$ 16 900 | 16 235 |
| Obligations du Trésor américain 3,000 % éch. 15/02/2048 | 11 800 | 8 617 | Billets du Trésor américain 3,375 % éch. 15/05/2033 | 7 700 | 7 162 |
| Billets du Trésor américain 3,375 % éch. 15/05/2033 | 7 700 | 7 473 | Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 15/08/2033 | 7 100 | 6 731 |
| Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 15/08/2033 | 7 100 | 6 589 | Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032 | 6 301 | 5 866 |
| Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032 | 7 100 | 6 326 | Obligations du Trésor américain 2,500 % éch. 15/02/2045 | 7 300 | 5 736 |
| Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/11/2032 | 5 300 | 5 542 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/11/2032 | 5 300 | 5 559 |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052 | 5 100 | 5 509 | Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/08/2043 | 5 900 | 5 505 |
| Obligations du Trésor américain 4,375 % éch. 15/08/2043 | 5 900 | 5 352 | Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052 | 5 100 | 5 230 |
| Obligations du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2047 | 6 900 | 5 336 | Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/02/2033 | 4 400 | 4 148 |
| Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/02/2033 | 4 400 | 4 452 | Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/02/2043 | 4 400 | 3 918 |
| Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/02/2043 | 4 400 | 4 416 | Obligations du Trésor américain 3,625 % éch. 15/02/2053 | 3 800 | 3 634 |
| Obligations du Trésor américain 3,625 % éch. 15/02/2053 | 3 800 | 3 722 | Obligations du Trésor américain 3,000 % éch. 15/02/2048 | 3 796 | 2 799 |
| Bank of America Corp. 5,288 % éch. 25/04/2034 | 3 700 | 3 696 | Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042 | 2 764 | 2 518 |
| Morgan Stanley 5,250 % éch. 21/04/2034 | 3 600 | 3 600 | Obligations du Trésor américain 3,375 % éch. 15/08/2042 | 2 800 | 2 490 |
| Synchrony Financial 7,250 % éch. 02/02/2033 | 3 600 | 3 587 | Vonovia SE 0,000 % éch. 01/12/2025 | € 2 300 | 2 175 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b) | 3 452 | 3 365 | Obligations du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2052 | \$ 2 600 | 2 154 |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042 | 3 200 | 3 348 | Synchrony Financial 7,250 % éch. 02/02/2033 | 2 400 | 2 127 |
| Amgen, Inc. 5,600 % éch. 02/03/2043 | 3 075 | 3 066 | RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % éch. 16/11/2025 | 2 006 | 1 954 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % éch. 05/09/2027 | € 2 300 | 2 491 | DaVita, Inc. 4,625 % éch. 01/06/2030 | 2 200 | 1 829 |

(a) Le Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds US Short-Term Fund

31 décembre 2023 (non auditées)

| DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | COÛT (en milliers) | DESCRIPTION | VALEUR NOMINALE (en milliers) | PRODUIT (en milliers) |
|---|-------------------------------------|-----------------------|---|-------------------------------------|--------------------------|
| ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | | VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2023 | | |
| Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 31/01/2028 | \$ 71 500 | \$ 71 193 | Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 31/01/2028 | \$ 71 500 | \$ 71 556 |
| Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/07/2028 | 42 600 | 42 074 | Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025 | 63 700 | 62 354 |
| Federal Home Loan Bank 5,660 % éch. 26/08/2024 | 40 000 | 40 000 | ACTIONS | | |
| Federal Home Loan Bank 5,500 % éch. 08/05/2025 | 38 000 | 38 000 | PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a) | 431 565 | 42 943 |
| Freddie Mac 5,950 % éch. 21/03/2025 | 33 000 | 33 000 | VALEUR NOMINALE (en milliers) | | |
| Freddie Mac 5,550 % éch. 09/05/2025 | 25 000 | 25 000 | Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/07/2028 | \$ 42 600 | 42 147 |
| Freddie Mac 5,520 % éch. 28/05/2025 | 22 400 | 22 400 | Federal Home Loan Bank 1,115 % éch. 26/02/2027 | 31 500 | 27 837 |
| Federal Home Loan Bank 5,480 % éch. 26/02/2025 | 22 400 | 22 400 | Federal Home Loan Bank 0,900 % éch. 26/02/2027 | 26 500 | 22 994 |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 22 560 | 21 865 | Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/07/2051 | 25 968 | 22 345 |
| Federal Home Loan Bank 5,650 % éch. 28/05/2025 | 21 000 | 21 000 | Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/06/2051 | 22 856 | 19 763 |
| Freddie Mac 5,820 % éch. 20/03/2025 | 21 000 | 21 000 | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 6,449 % éch. 21/03/2024 | 17 700 | 17 707 |
| Freddie Mac 5,730 % éch. 03/04/2025 | 21 000 | 21 000 | Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0,850 % éch. 10/02/2027 | 18 800 | 16 711 |
| Freddie Mac 5,680 % éch. 03/04/2025 | 21 000 | 21 000 | Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % éch. 15/03/2025 | 16 700 | 15 975 |
| Federal Home Loan Bank 5,980 % éch. 17/07/2025 | 20 600 | 20 600 | Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % éch. 15/12/2023 | 15 979 | 15 819 |
| Morgan Stanley 0,790 % éch. 30/05/2025 | 21 500 | 20 390 | Danske Bank A/S 5,375 % éch. 12/01/2024 | 14 850 | 14 765 |
| Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,788 % éch. 19/10/2031 | 20 250 | 20 136 | Wells Fargo & Co. 6,701 % éch. 25/04/2026 | 14 500 | 14 617 |
| Federal Home Loan Bank 5,710 % éch. 14/03/2025 | 20 000 | 20 000 | BAT Capital Corp. 3,222 % éch. 15/08/2024 | 14 750 | 14 315 |
| Freddie Mac 5,800 % éch. 03/07/2025 | 20 000 | 20 000 | AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % éch. 29/10/2023 | 12 950 | 12 734 |
| Wells Fargo & Co. 2,406 % éch. 30/10/2025 | 17 800 | 17 036 | Eni SpA 4,000 % éch. 12/09/2023 | 11 800 | 11 743 |
| Lloyds Banking Group PLC 3,870 % éch. 09/07/2025 | 17 000 | 16 635 | Thermo Fisher Scientific, Inc. 5,562 % éch. 18/10/2024 | 11 500 | 11 498 |
| Barclays PLC 3,932 % éch. 07/05/2025 | 15 500 | 15 176 | Ginnie Mae 2,500 % éch. 20/06/2051 | 13 399 | 11 253 |
| Athene Global Funding 6,108 % éch. 24/05/2024 | 14 200 | 14 073 | Boeing Co. 1,433 % éch. 04/02/2024 | 10 900 | 10 596 |
| Hyundai Capital America 6,532 % éch. 04/08/2025 | 14 000 | 14 000 | Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b) | 10 793 | 10 490 |
| HCA, Inc. 5,000 % éch. 15/03/2024 | 14 000 | 13 906 | DBS Group Holdings Ltd. 2,591 % éch. 20/01/2028 | 10 000 | 10 021 |
| CIFC Funding Ltd. 6,710 % éch. 24/04/2030 | 13 891 | 13 791 | AerCap Ireland Capital DAC 4,500 % éch. 15/09/2023 | 10 000 | 9 940 |
| Westpac Banking Corp. 4,862 % éch. 16/11/2023 | AUD 20 000 | 13 782 | Crédit Agricole S.A. 6,570 % éch. 22/03/2024 | 9 400 | 9 439 |
| | | | Hyatt Hotels Corp. 1,300 % éch. 01/10/2023 | 9 400 | 9 257 |
| | | | Mizuho Financial Group, Inc. 6,123 % éch. 08/09/2024 | 9 200 | 9 205 |
| | | | Nomura Holdings, Inc. 1,851 % éch. 16/07/2025 | 9 773 | 8 958 |
| | | | CNH Industrial Capital LLC 4,200 % éch. 15/01/2024 | 9 000 | 8 911 |
| | | | General Motors Financial Co., Inc. 5,100 % éch. 17/01/2024 | 8 670 | 8 622 |
| | | | Bank of America Corp. 5,791 % éch. 24/10/2024 | 7 500 | 7 502 |

(a) Le Fonds US Short-Term Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Taux de rotation du portefeuille

Le présent rapport a été préparé à l'appui des communications aux investisseurs institutionnels dans le cadre de la Directive sur les droits des actionnaires II.

La durée pendant laquelle un Fonds a détenu un titre donné n'est généralement pas prise en compte lors des décisions d'investissement. Un changement apporté aux titres détenus par un Fonds est appelé « rotation de portefeuille ». Pour atteindre son objectif d'investissement, chaque Fonds peut procéder à des transactions fréquentes et actives de titres de portefeuille, en particulier dans des périodes de fluctuations volatiles du marché. Un taux de rotation élevé du portefeuille est susceptible d'impliquer des frais de transaction correspondants supérieurs pour le Fonds, notamment des commissions de courtage ou de négociation et autres frais de transaction sur la vente de titres et les réinvestissements dans d'autres titres. De telles ventes peuvent entraîner la réalisation de plus-values imposables, notamment des plus-values à court terme (qui sont généralement imposées aux taux de l'impôt sur le revenu habituel lorsqu'elles sont distribuées aux actionnaires). Les frais de transaction associés au taux de rotation des portefeuilles peuvent peser sur la performance d'un Fonds.

Les types de titres suivants sont exclus du calcul du taux de rotation du portefeuille : fonds de placement affiliés, instruments financiers dérivés, TBA Mortgage Dollar Rolls, ventes-rachats et autres instruments à court terme dont l'échéance est inférieure à 365 jours.

Le taux de rotation du portefeuille pour l'exercice clos le 31 décembre 2023 de chaque Fonds est le suivant :

| Nom du Fonds | Taux de rotation du portefeuille pour 2023 |
|---|--|
| Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund | 45 % |
| Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund | 69 % |
| Fonds PIMCO Balanced Income and Growth Fund | 591 % |
| Fonds PIMCO Capital Securities Fund | 50 % |
| Fonds PIMCO Climate Bond Fund | 35 % |
| Fonds Commodity Real Return Fund | 47 % |
| Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 154 % |
| Fonds Diversified Income Fund | 56 % |
| Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund | 104 % |
| Fonds Diversified Income ESG Fund | 29 % |
| Fonds Dynamic Bond Fund | 140 % |
| Fonds Dynamic Multi-Asset Fund | 91 % |
| Fonds Emerging Local Bond Fund | 114 % |
| Fonds Emerging Local Bond ESG Fund | 48 % |
| Fonds Emerging Markets Bond Fund | 39 % |
| Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | 51 % |
| Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund | 46 % |
| Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 164 % |
| Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 135 % |
| Fonds PIMCO ESG Income Fund | 174 % |
| Fonds Euro Bond Fund | 95 % |
| Fonds Euro Credit Fund | 104 % |
| Fonds Euro Income Bond Fund | 140 % |
| Fonds Euro Long Average Duration Fund | 76 % |
| Fonds Euro Short-Term Fund | 69 % |
| Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | 55 % |
| Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 79 % |
| Fonds Global Advantage Fund | 107 % |
| Fonds Global Bond Fund | 161 % |
| Fonds Global Bond ESG Fund | 59 % |
| Fonds Global Bond Ex-US Fund | 91 % |
| Fonds Global High Yield Bond Fund | 41 % |

| Nom du Fonds | Taux de rotation du portefeuille pour 2023 |
|--|--|
| Fonds Global Investment Grade Credit Fund | 68 % |
| Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | 71 % |
| Fonds Global Low Duration Real Return Fund | 25 % |
| Fonds Global Real Return Fund | 28 % |
| Fonds Income Fund | 147 % |
| Fonds Income Fund II | 57 % |
| Fonds Inflation Multi-Asset Fund | 120 % |
| Fonds Low Average Duration Fund | 80 % |
| Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 49 % |
| Fonds Low Duration Income Fund | 124 % |
| Fonds Low Duration Opportunities Fund | 33 % |
| Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund | 112 % |
| Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 28 % |
| Fonds Mortgage Opportunities Fund | 512 % |
| Fonds StocksPLUS™ Fund | 77 % |
| Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 222 % |
| Fonds Strategic Income Fund | 130 % |
| Fonds Total Return Bond Fund | 115 % |
| Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 374 % |
| Fonds UK Corporate Bond Fund | 59 % |
| Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund | 35 % |
| Fonds US High Yield Bond Fund | 37 % |
| Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund | 55 % |
| Fonds US Short-Term Fund | 29 % |

Toutes les données présentées dans les annexes suivantes ont été calculées sur la base des titres en portefeuille du Fonds concerné au 31 décembre 2023 et constituent des informations non auditées qui n'ont pas fait l'objet d'une quelconque assurance fournie par les Auditeurs ou par un tiers. Toutes les données et autres informations contenues dans les annexes ont été compilées conformément au cadre interne de finance durable mis en œuvre par le Gestionnaire et le Conseiller en investissement pour le Fonds concerné. Le Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund est classé conformément à l'article 8 du Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers depuis le 29 septembre 2023.

Règlement européen sur la taxinomie

Pour les Fonds classés conformément à l'article 8 ou à l'article 9 du SFDR, veuillez vous reporter à l'Annexe de chaque Fonds, ci-joint, afin d'obtenir des informations relatives à l'alignement avec le Règlement UE/2020/852, communément appelé Règlement européen sur la taxinomie. Pour les Fonds qui ne sont pas classés conformément à l'Article 8 (c.-à-d. ne promouvant pas de caractéristiques environnementales et/ou sociales) ou à l'Article 9 (c'est-à-dire qui n'ont pas d'objectif d'investissement durable) en vertu du SFDR, les investissements sous-jacents ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

ANNEXE IV

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 : Fonds PIMCO Capital Securities Fund Identifiant d'entité juridique : 549300LOUVRKJJJKO09

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 taxonomie de l'UE

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

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

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales/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 taxonomie 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 taxonomie 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 **taxonomie 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 taxonomie.



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

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|--|----------------------------|-------------|
| Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % | Crédit de qualité « investment grade » | 3,23 % | Pays-Bas |
| Crédit Agricole S.A. 7,250 % échéance 23/09/2028 | Crédit de qualité « investment grade » | 2,59 % | France |
| Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % échéance 24/06/2024 | Crédit de qualité « investment grade » | 2,16 % | Royaume-Uni |
| Nationwide Building Society 10,250 % | Crédit de qualité « investment grade » | 1,83 % | Royaume-Uni |
| Bank of Ireland Group PLC 7,500 % échéance 19/05/2025 | Crédit à rendement élevé | 1,73 % | Irlande |
| HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % échéance 05/11/2031 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,73 % | Jersey |
| Lloyds Banking Group PLC 4,947 % échéance 27/06/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,65 % | Royaume-Uni |
| Bons du Trésor américain 5,489 % échéance 23/01/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 1,56 % | États-Unis |
| Cooperatieve Rabobank UA 3,100 % échéance 29/06/2028 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,36 % | Pays-Bas |
| NatWest Group PLC 6,000 % échéance 29/12/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,34 % | Royaume-Uni |
| Lloyds Banking Group PLC 7,875 % échéance 27/06/2029 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,28 % | Royaume-Uni |
| KBC Group NV 4,250 % échéance 24/10/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,26 % | Belgique |
| Erste Group Bank AG 4,250 % échéance 15/10/2027 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,25 % | Autriche |
| Intesa Sanpaolo SpA 9,125 % échéance 07/09/2029 | Crédit à rendement élevé | 1,25 % | Italie |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 8,200 % échéance 15/01/2029 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,21 % | Japon |

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

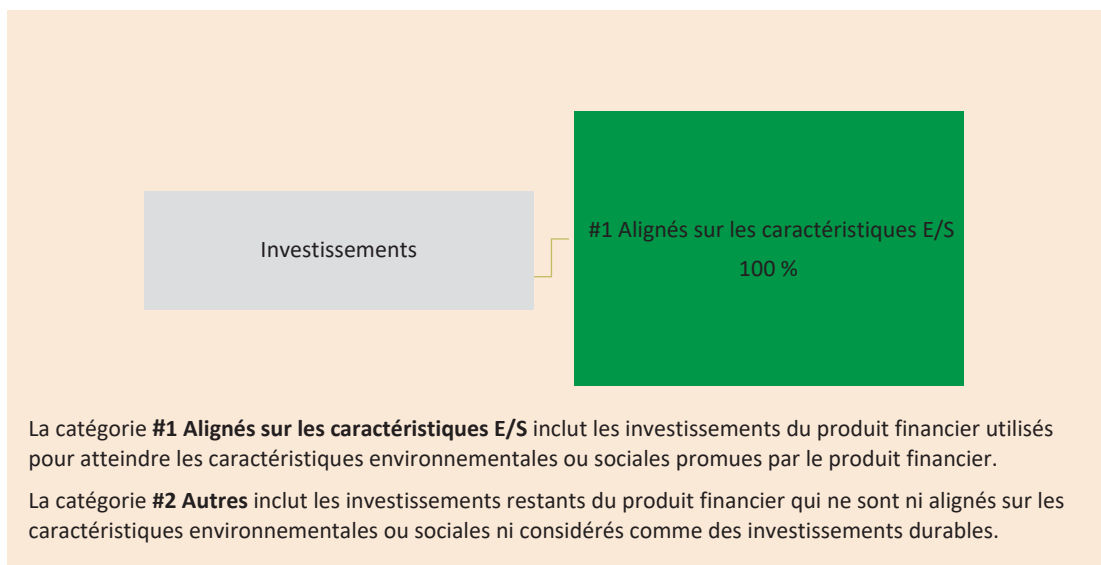


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

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



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %). Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Crédit de qualité « investment grade » | 63,65 % |
| Crédit à rendement élevé | 27,11 % |
| Titres liés à un gouvernement | 13,94 % |
| Dette extérieure des Marchés émergents | 0,02 % |
| Autres instruments nets à durée courte | -4,72 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

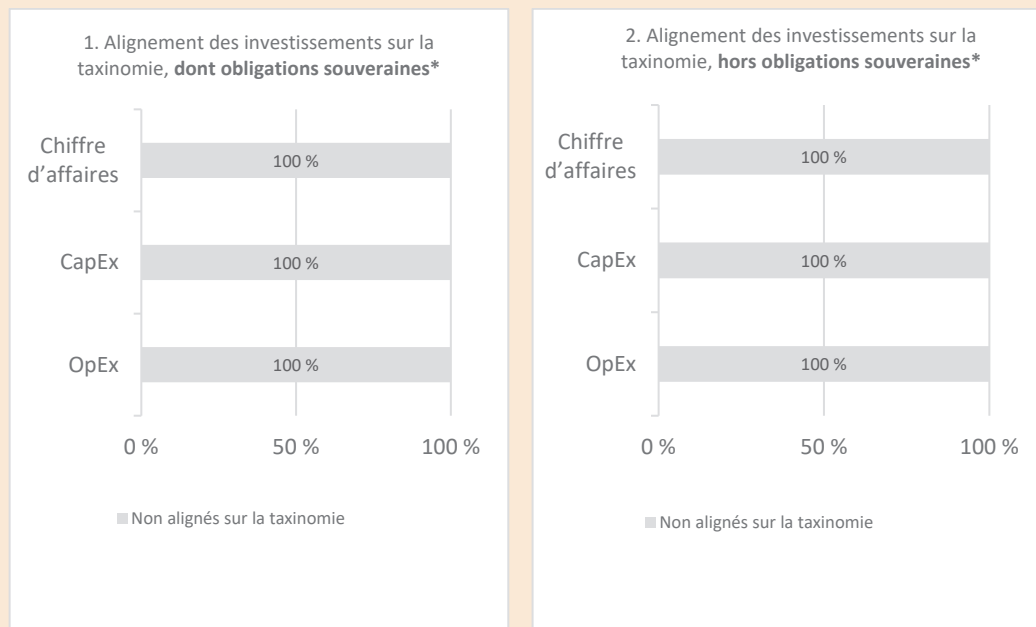
Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs. (31 décembre 2022 : 100 %).

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE V

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 9, paragraphes 1 à 4 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit :
Fonds PIMCO Climate Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300KBV832SKE8DW37

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



Oui

Il a réalisé **des investissements durables ayant un objectif environnemental** :
92 %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxonomie de l'UE

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

Il a réalisé **des investissements durables ayant un objectif social** : **1 %****

**Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature



Non

Il **promouvait des caractéristiques environnementales/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 taxonomie 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 taxonomie 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 l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Durant la période couverte, le Fonds a visé des rendements ajustés au risque optimaux, en appliquant une gestion prudente des investissements, tout en tenant compte des risques et des opportunités à long terme liés au climat.

Comme indiqué plus en détail ci-dessous, dans la section « Allocation des actifs », le Fonds a investi dans des investissements durables composés de Titres ESG à revenu fixe (tels que décrits plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** ») qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement et qui ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les produits dérivés détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la stratégie d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés dans le but d'atteindre l'objectif d'investissement durable du Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de l'objectif d'investissement durable du Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** »).

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles. En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

● **Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable ?**

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent de préjudice important à aucun objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs concernant les incidences négatives sur la durabilité, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles et les émissions de gaz à effet de serre.

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

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection a pris en compte les incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs 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.

aux secteurs liés aux combustibles fossiles. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

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 :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection relative aux controverses du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.



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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.

Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et des exclusions.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|---|---------------------|-----------------|
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 % échéance 07/06/2032 | Titres liés à un gouvernement | 6,02 % | Allemagne |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % échéance 15/11/2029 | Titres liés à un gouvernement | 4,28 % | Allemagne |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/10/2053 | Crédit titrisé | 2,40 % | États-Unis |
| Banque européenne d'investissement 1,500 % échéance 15/06/2032 | Titres liés à un gouvernement | 2,17 % | Supranationales |
| Banque européenne d'investissement 3,750 % échéance 14/02/2033 | Titres liés à un gouvernement | 1,87 % | Supranationales |
| Obligation internationale du gouvernement canadien 2,250 % échéance 01/12/2029 | Titres liés à un gouvernement | 1,77 % | Canada |
| Bon du Trésor britannique 0,875 % échéance 31/07/2033 | Titres liés à un gouvernement | 1,41 % | Royaume-Uni |
| NTT Finance Corp. 4,239 % échéance 25/07/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,09 % | Japon |
| UniCredit SpA 5,850 % échéance 15/11/2027 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,98 % | Italie |
| Verizon Communications, Inc. 1,500 % échéance 18/09/2030 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,98 % | États-Unis |
| New York State Electric & Gas Corp. 5,650 % échéance 15/08/2028 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,90 % | États-Unis |
| Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % échéance 26/04/2027 | Obligations couvertes et Pfandbriefe | 0,89 % | Espagne |
| Nordea Bank Abp 6,000 % échéance 02/06/2026 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,88 % | Finlande |
| TDC Net A/S 5,618 % échéance 06/02/2030 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,83 % | Danemark |
| CaixaBank S.A. 3,750 % échéance 07/09/2029 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,82 % | Espagne |

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

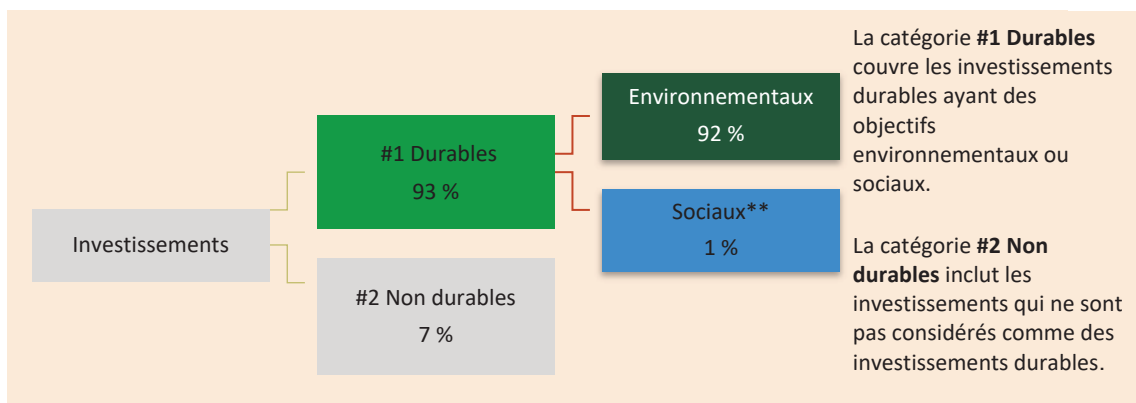


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion d'investissements durables du Fonds au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

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



Au 31 décembre 2023, le Fonds était entièrement composé d'investissements durables, à l'exception des investissements détenus à d'autres fins, telles que des fins de liquidité ou de couverture.

Au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 93 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 81 %). 92 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental (31 décembre 2022 : 80 %).

**Le Fonds détenait également 1 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social (31 décembre 2022 : 1 %). Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Le Fonds a investi 7 % de son actif net dans des investissements du Fonds ne constituant pas des « investissements durables » ; ils ont été utilisés à des fins de gestion globale des risques, notamment à des fins de liquidité ou de couverture (31 décembre 2022 : 19 %).

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Crédit de qualité « investment grade » | 49,48 % |
| Titres liés à un gouvernement | 42,43 % |
| Dettes extérieures des Marchés émergents | 5,47 % |
| Crédit titrisé | 4,33 % |
| Crédit à rendement élevé | 3,67 % |
| Obligations couvertes et Pfandbriefe | 1,53 % |
| Titres municipaux | 0,17 % |
| Autres instruments nets à durée courte | -7,08 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?



Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire



Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

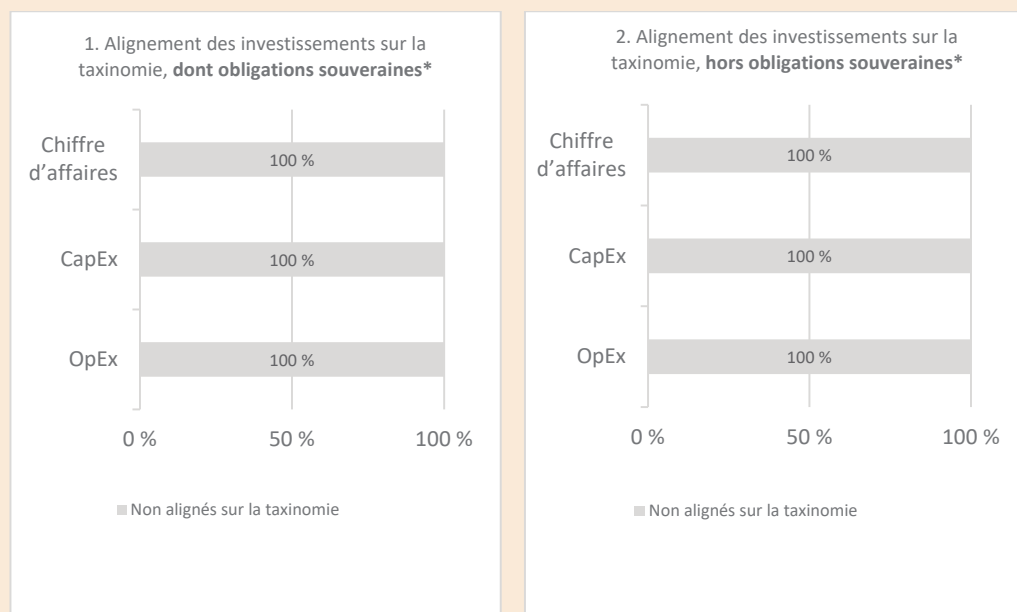
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2023, la part des investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 92 % (31 décembre 2022 : 80 %). Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



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

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds détenait 1 % dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social au cours de la période couverte par les états financiers (31 décembre 2022 : 1 %). Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.



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

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds était entièrement composé d'investissements durables, à l'exception des investissements détenus à d'autres fins, telles que des fins de liquidité ou de couverture. Comme décrit plus en détail ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 93 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 81 %).

La proportion d'investissements du Fonds qui ne constituaient pas des « investissements durables » a été utilisée à des fins de gestion globale des risques, notamment à des fins de liquidité ou de couverture. Les émetteurs et les instruments financiers dérivés utilisés pour atteindre ces objectifs ont été soumis à des présélections basées sur des critères ESG qui visent à garantir le respect de garanties environnementales et/ou sociales minimales pertinentes.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 :
Fonds Diversified Income ESG Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300ECS7VMY4LHDC04

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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** : ___%

Non

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 35 % 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**

**Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature

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



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

L'approche du Fonds en matière de durabilité passe par la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et/ou d'atténuation du changement climatique.

Les produits dérivés (à l'exception des produits dérivés sur indice) détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la stratégie d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds.

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 ?*

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** ») qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles (y compris les émetteurs principalement actifs dans l'industrie pétrolière, y compris dans l'extraction, la production, le raffinage et le transport de pétrole, ou dans l'extraction et la vente de charbon et la production d'électricité à partir de charbon).

En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

● *...et par rapport aux périodes précédentes ?*

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** »), dont les obligations vertes.

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

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent de préjudice important à aucun objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs concernant les incidences négatives sur la durabilité, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et les émissions de gaz à effet de serre.

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

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et aux armes militaires. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de sa stratégie d'exclusion et de son engagement envers les émetteurs.

— **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 :**

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection relative aux controverses du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs 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.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ». Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement envers les émetteurs et les exclusions.

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles [comme décrit plus haut], au secteur des armes militaires et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|--|---------------------|------------|
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund | Autres | 6,77 % | Irlande |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund | Crédit de qualité « investment grade » | 2,73 % | Irlande |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 2,67 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 1,76 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % échéance 01/03/2053 | Crédit titrisé | 1,68 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/04/2053 | Crédit titrisé | 1,65 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % échéance 01/05/2053 | Crédit titrisé | 1,52 % | États-Unis |

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et du Règlement sur la taxonomie (non auditées) (suite)

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|--|---------------------|------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 1,40 % | États-Unis |
| Obligation internationale du gouvernement panaméen 6,700 % échéance 26/01/2036 | Dettes extérieures des Marchés émergents | 1,21 % | Panama |
| Bank of America Corp. 6,204 % échéance 10/11/2028 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,10 % | États-Unis |
| JPMorgan Chase & Co. 2,580 % échéance 22/04/2032 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,88 % | États-Unis |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % échéance 06/06/2032 | Dettes extérieures des Marchés émergents | 0,88 % | Indonésie |
| Sprint Capital Corp. 8,750 % échéance 15/03/2032 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,86 % | États-Unis |
| Obligations du Trésor américain 3,875 % échéance 15/05/2043 | Titres liés à un gouvernement | 0,83 % | États-Unis |
| SBA Communications Corp. 3,125 % échéance 01/02/2029 | Crédit à rendement élevé | 0,78 % | États-Unis |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

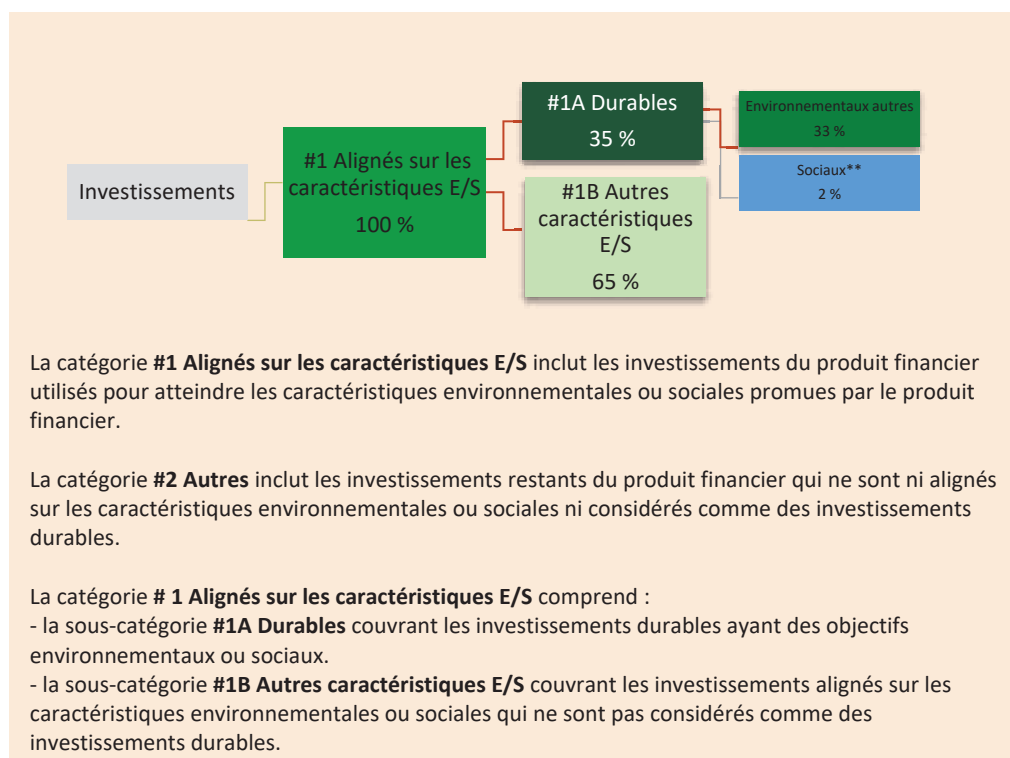


L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la part du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 35 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 47 %). 33 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental (31 décembre 2022 : 45 %).

**Le Fonds détenait également 2 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social (31 décembre 2022 : 2 %). Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Crédit de qualité « investment grade » | 34,81 % |
| Crédit à rendement élevé | 27,23 % |
| Dette extérieure des Marchés émergents | 16,79 % |
| Crédit titrisé | 11,52 % |
| Autres | 6,79 % |
| Autres instruments nets à durée courte | 1,78 % |
| Titres liés à un gouvernement | 0,67 % |
| Dette locale des Marchés émergents | 0,41 % |

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer 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.

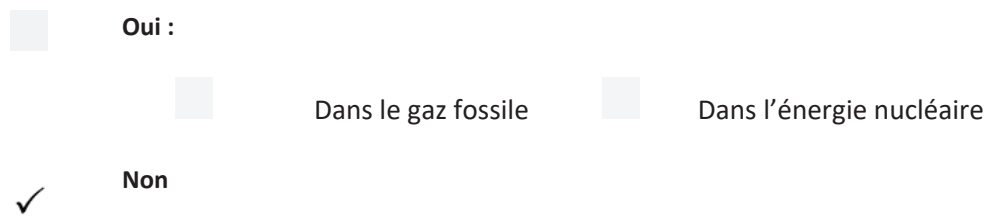
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?



Non

Dans le gaz fossile

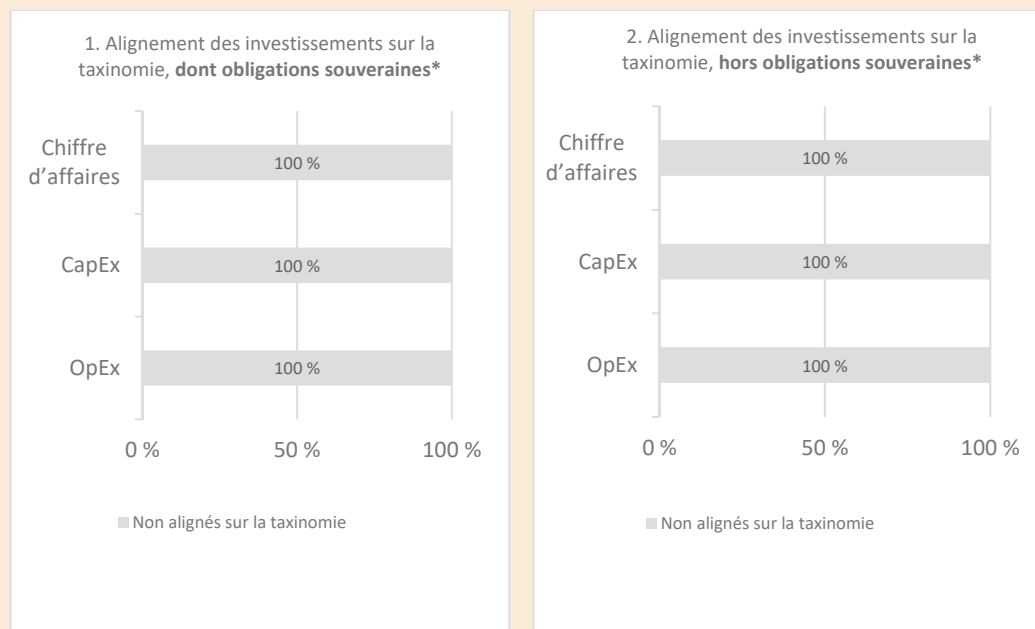
Dans l'énergie nucléaire

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2023, la part des investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 33 % (31 décembre 2022 : 45 %). Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



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

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds détenait 2 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers (31 décembre 2022 : 2 %). Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Comme indiqué plus en détail ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 35 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 47 %).



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat et à la biodiversité), par exemple, en cherchant à encourager les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 : Fonds Dynamic Multi-Asset Fund **Identifiant d'entité juridique :** 549300ZZOV14P64W6594

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?
 Oui
 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** : ___%

 Non
 Il **promouvait des caractéristiques environnementales/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 ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|---|---------------------|------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 9,26 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 6,19 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 5,58 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 4,60 % | États-Unis |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF | Autres instruments nets à duration courte | 4,60 % | Irlande |
| SNCF Réseau 4,500 % échéance 30/01/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 3,66 % | France |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Income Fund | Municipal/autre | 3,27 % | Irlande |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/07/2032 | Titres liés à un gouvernement | 3,22 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2054 | Crédit titrisé | 3,15 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,257) % échéance 04/04/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 2,79 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 2,39 % | États-Unis |
| Oesterreichische Kontrollbank AG 3,990 % échéance 22/01/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 1,99 % | Autriche |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | Crédit titrisé | 1,78 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,238) % échéance 15/01/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 1,27 % | Japon |
| Bons du Trésor suisse 1,697 % échéance 14/03/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 0,99 % | Suisse |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

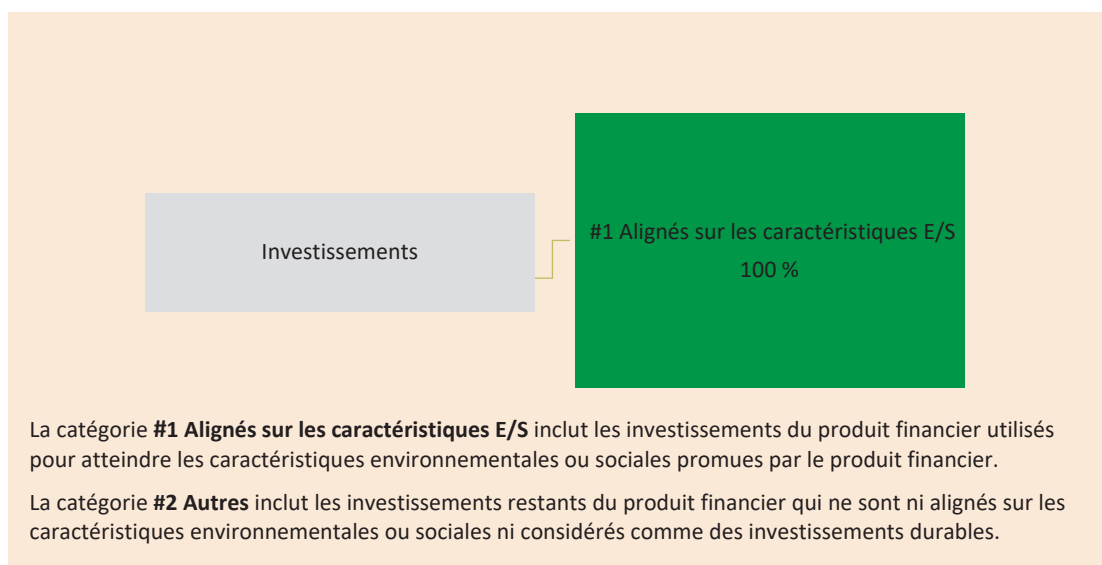


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

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



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %). Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Titres liés à un gouvernement | 43,53 % |
| Municipal/autre | 38,40 % |
| Crédit titrisé | 37,84 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 8,86 % |
| Marchés émergents | 1,90 % |
| Crédit à rendement élevé | 0,67 % |
| Instruments nets à durée courte | -31,20 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● **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'UE¹ ?**

Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

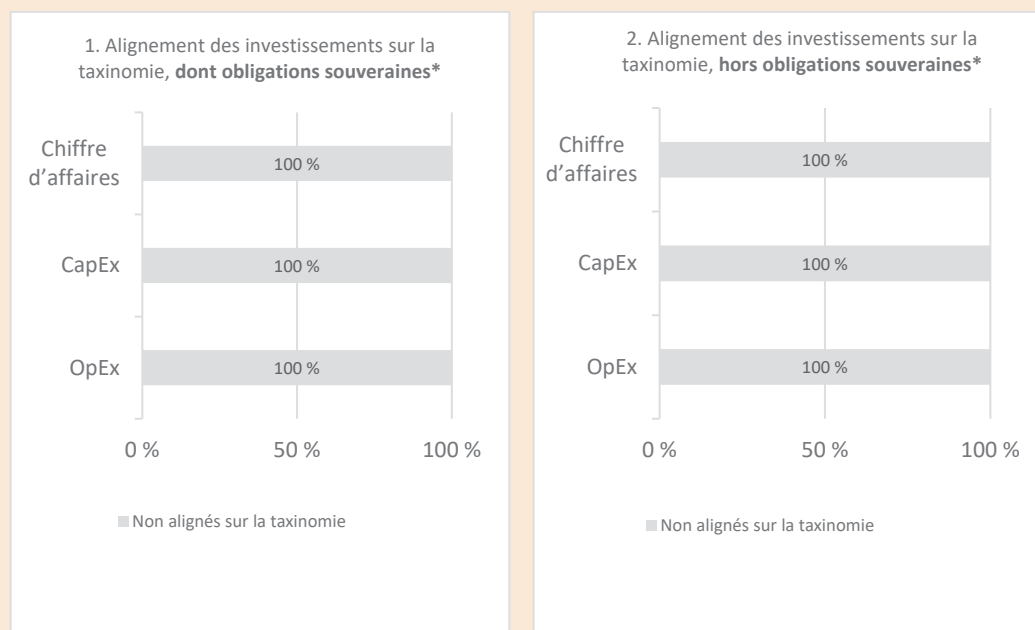
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs. (31 décembre 2022 : 100 %).

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 :
Fonds Emerging Local Bond ESG Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300XJ4S7ZD2HUGI18

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Oui | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non |
|---|--|
| <input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___% | <input checked="" type="checkbox"/> 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 19 % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> 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 <input checked="" type="checkbox"/> 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 <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif social** <p>**Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature</p> <input type="checkbox"/> 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 ?

L'approche du Fonds en matière de durabilité passe par la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et/ou d'atténuation du changement climatique.

Les produits dérivés (à l'exception des produits dérivés sur indice) détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la stratégie d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds.

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 ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** ») qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles (y compris les émetteurs principalement actifs dans l'industrie pétrolière, y compris dans l'extraction, la production, le raffinage et le transport de pétrole, ou dans l'extraction et la vente de charbon et la production d'électricité à partir de charbon).

En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** »), dont les obligations vertes.

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

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent de préjudice important à aucun objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs concernant les incidences négatives sur la durabilité, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et les émissions de gaz à effet de serre.

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

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et aux armes militaires. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de sa stratégie d'exclusion et de son engagement envers les émetteurs.

— **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 :**

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection relative aux controverses du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs 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.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ». Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement envers les émetteurs et les exclusions.

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles [comme décrit plus haut], au secteur des armes militaires et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|-------------------------------|---------------------|----------------|
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % échéance 31/01/2030 | Marchés émergents | 3,82 % | Afrique du Sud |
| TES colombien 7,000 % échéance 26/03/2031 | Marchés émergents | 3,58 % | Colombie |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 3,750 % échéance 25/05/2027 | Titres liés à un gouvernement | 2,15 % | Pologne |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % échéance 21/12/2026 | Marchés émergents | 1,96 % | Afrique du Sud |
| Bons du Trésor hongrois 10,900 % échéance 04/01/2024 | Marchés émergents | 1,96 % | Hongrie |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % échéance 17/06/2028 | Marchés émergents | 1,73 % | Thaïlande |
| Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,390 % échéance 17/06/2037 | Marchés émergents | 1,71 % | Thaïlande |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,750 % échéance 29/05/2031 | Marchés émergents | 1,69 % | Mexique |

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir :

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|---|---------------------|--------------------|
| Obligation internationale du gouvernement hongrois 4,500 % échéance 27/05/2032 | Marchés émergents | 1,67 % | Hongrie |
| Bons du Trésor américain 2,070 % échéance 23/01/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 1,65 % | États-Unis |
| Obligation internationale du Gouvernement indonésien 8,250 % échéance 15/05/2036 | Marchés émergents | 1,65 % | Indonésie |
| Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % échéance 12/08/2033 | Marchés émergents | 1,65 % | Pérou |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 2,750 % échéance 27/11/2031 | Marchés émergents | 1,60 % | Mexique |
| Obligation internationale du gouvernement de République tchèque 0,050 % échéance 29/11/2029 | Titres liés à un gouvernement | 1,60 % | République tchèque |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 6,000 % échéance 25/10/2033 | Titres liés à un gouvernement | 1,58 % | Pologne |

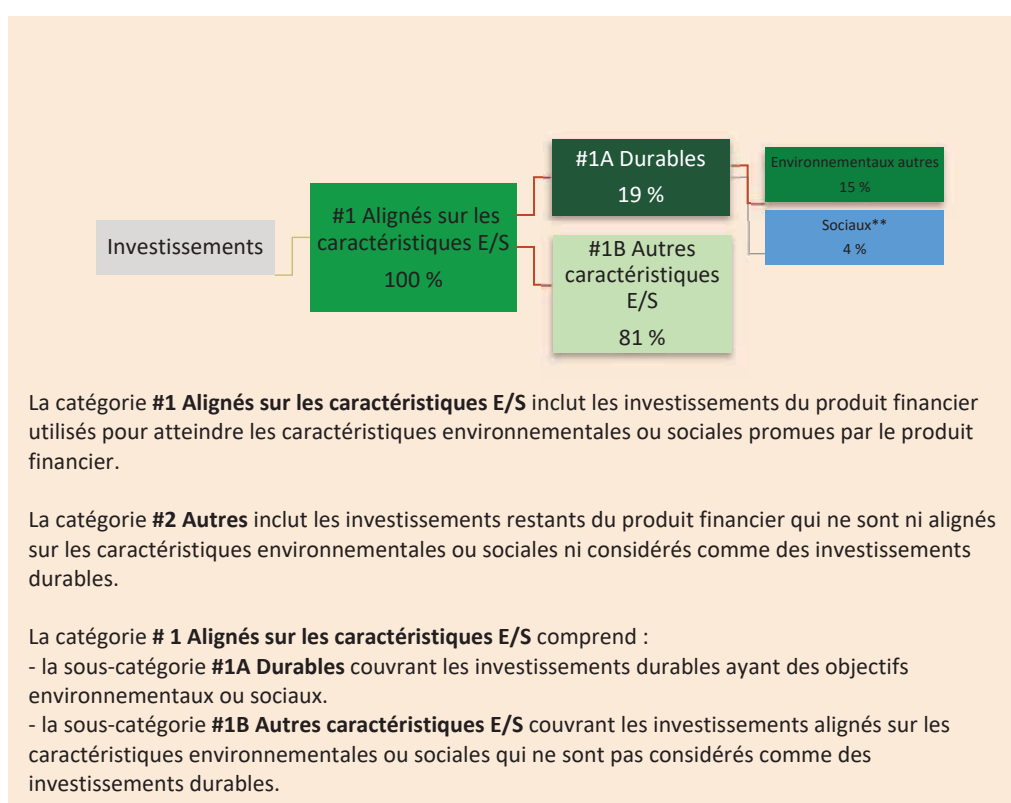
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la part du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 19 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 27 %). 15 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental (31 décembre 2022 : 21 %).

**Le Fonds détenait également 4 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social (31 décembre 2022 : 6 %). Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|---|---------------------|
| Marchés émergents | 59,89 % |
| Titres liés à un gouvernement | 28,64 % |
| Autres instruments nets à duration courte | 11,47 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxonomie de l'UE¹ ?**



Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire



Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxonomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxonomie 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.

Pour être conformes 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 renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

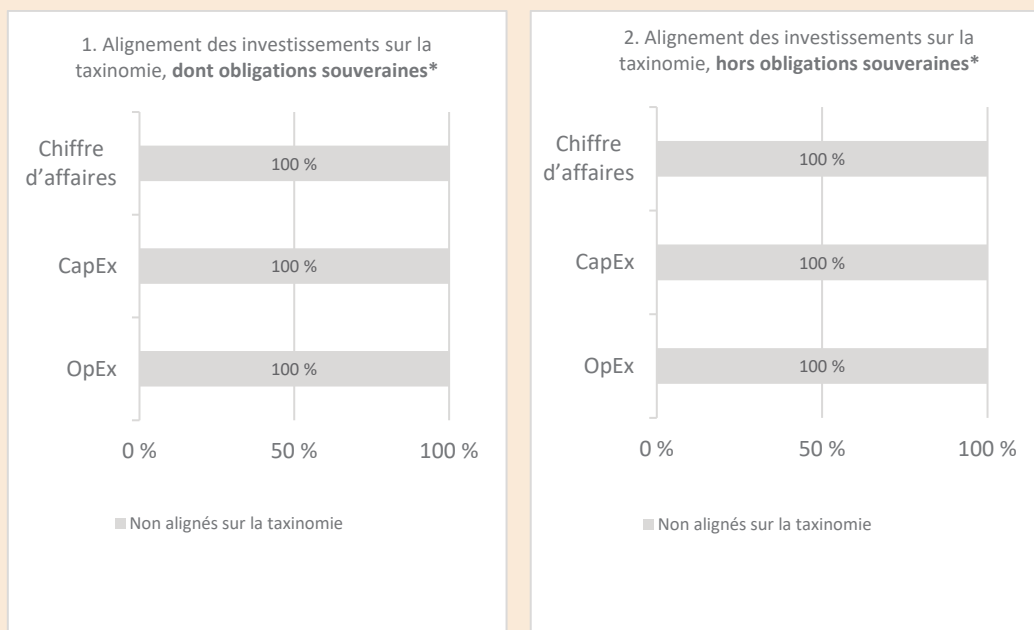
Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

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.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2023, la part des investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 15 % (31 décembre 2022 : 21 %). Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux 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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds détenait 4 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers (31 décembre 2022 : 6 %). Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Comme indiqué plus en détail ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 19 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 27 %).



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat et à la biodiversité), par exemple, en cherchant à encourager les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 :
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

Identifiant d'entité juridique :
IU161HZ5QHJ5X3UAQ421

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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** : ___%

Non

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 34 % 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**

**Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature

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 ?

L'approche du Fonds en matière de durabilité passe par la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et/ou d'atténuation du changement climatique.

Les produits dérivés (à l'exception des produits dérivés sur indice) détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la stratégie d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds.

● *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?*

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** ») qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles (y compris les émetteurs principalement actifs dans l'industrie pétrolière, y compris dans l'extraction, la production, le raffinage et le transport de pétrole, ou dans l'extraction et la vente de charbon et la production d'électricité à partir de charbon).

En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

● *...et par rapport aux périodes précédentes ?*

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs 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.

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

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** »), dont les obligations vertes.

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

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent de préjudice important à aucun objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs concernant les incidences négatives sur la durabilité, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et les émissions de gaz à effet de serre.

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

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et aux armes militaires. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de sa stratégie d'exclusion et de son engagement envers les émetteurs.

— *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 :*

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection relative aux controverses du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ». Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement envers les émetteurs et les exclusions.

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles [comme décrit plus haut], au secteur des armes militaires et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|---------------------------------------|---------------------|------------------------|
| Obligations du Trésor américain 3,250 % échéance 15/05/2042 | Titres liés au gouvernement américain | 1,90 % | États-Unis |
| Bons du Trésor hongrois 10,900 % échéance 04/01/2024 | Marchés émergents | 1,54 % | Hongrie |
| Obligation internationale du gouvernement argentin 3,500 % échéance 09/07/2041 | Marchés émergents | 1,32 % | Argentine |
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,000 % échéance 03/12/2026 | Marchés émergents | 1,25 % | Mexique |
| Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % échéance 21/12/2026 | Marchés émergents | 1,20 % | Afrique du Sud |
| Obligation internationale du gouvernement de la République dominicaine 5,875 % échéance 30/01/2060 | Marchés émergents | 1,01 % | République dominicaine |
| Billets du Trésor américain 3,125 % échéance 31/08/2029 | Titres liés au gouvernement américain | 0,98 % | États-Unis |

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|---------------------------------------|---------------------|------------|
| Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,875 % échéance 19/05/2033 | Marchés émergents | 0,92 % | Mexique |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/10/2053 | Crédit titrisé | 0,92 % | États-Unis |
| Obligation internationale du gouvernement roumain 2,124 % échéance 16/07/2031 | Marchés émergents | 0,90 % | Roumanie |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % échéance 06/06/2032 | Marchés émergents | 0,89 % | Indonésie |
| Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 3,500 % échéance 31/07/2035 | Marchés émergents | 0,88 % | Équateur |
| Obligations du Trésor américain 3,375 % échéance 15/08/2042 | Titres liés au gouvernement américain | 0,84 % | États-Unis |
| Obligation internationale du gouvernement uruguayen 5,750 % échéance 28/10/2034 | Autres | 0,84 % | Uruguay |
| Obligation internationale du gouvernement polonais 4,875 % échéance 04/10/2033 | Autres | 0,83 % | Pologne |

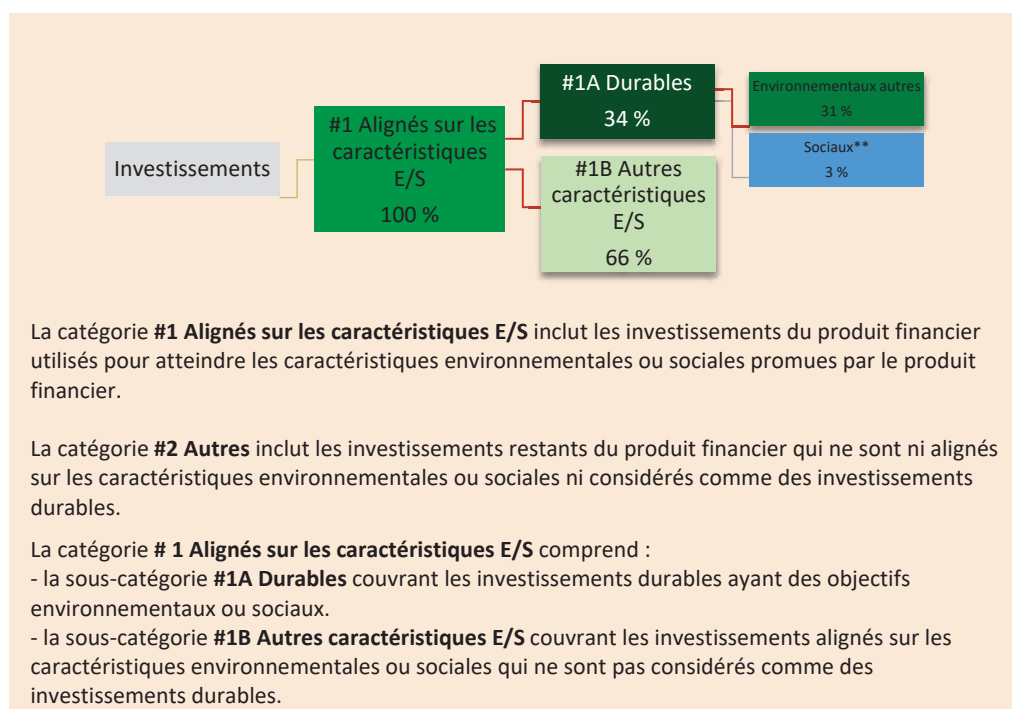
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la part du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



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

Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (le chiffre au 31 décembre 2022 était de 100 %).

Au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 34 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 25 %). 31 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental (31 décembre 2022 : 23 %).

**Le Fonds détenait également 3 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social (31 décembre 2022 : 2 %). Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Marchés émergents | 72,00 % |
| Titres liés au gouvernement américain | 18,30 % |
| Autres | 14,05 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 11,91 % |
| Titres de pays développés libellés dans une devise autre que le dollar américain | 4,85 % |
| Crédit titrisé | 3,80 % |
| Autres instruments nets à duration courte | -24,91 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

Pour être conformes 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 renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

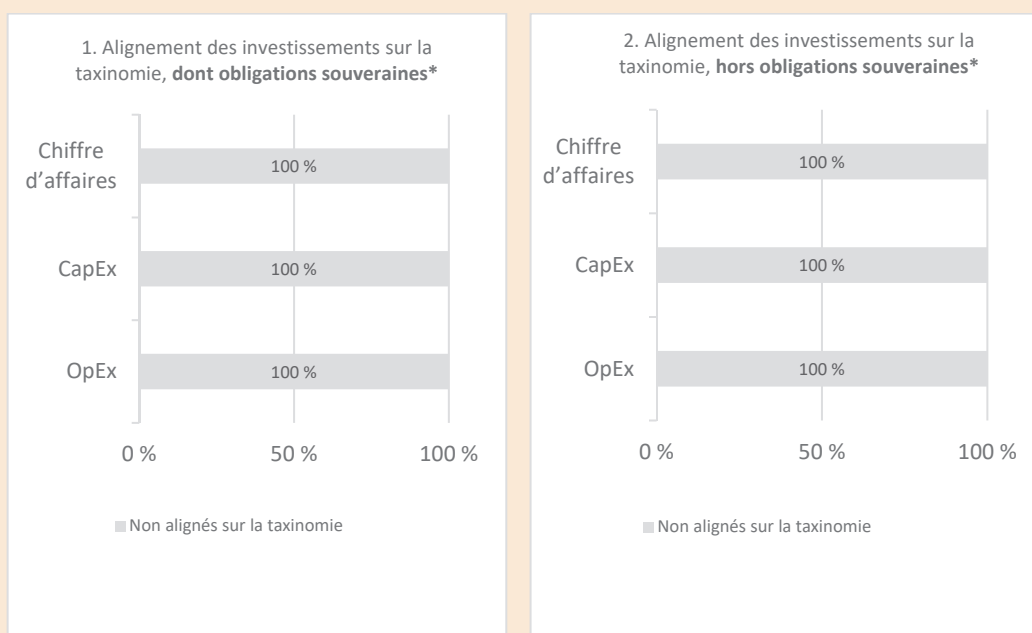
Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

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.

● **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'UE¹ ?**

- Oui :**
 Dans le gaz fossile 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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2023, la part des investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 31 % (31 décembre 2022 : 23 %). Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



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

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds détenait 3 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers (31 décembre 2022 : 2 %). Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.



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 ?


Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Comme indiqué plus en détail ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 34 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 25 %).



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat et à la biodiversité), par exemple, en cherchant à encourager les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

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

ANNEXE IV

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 : Fonds PIMCO ESG Income Fund Identifiant d'entité juridique : 549300TKMFF4LMUCRB73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● **Oui**

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** : ___%

●● **Non**

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 57 % 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*

**Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature

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 ?

L'approche du Fonds en matière de durabilité passe par la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et/ou d'atténuation du changement climatique.

Les produits dérivés (à l'exception des produits dérivés sur indice) détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la stratégie d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** ») qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles (y compris les émetteurs principalement actifs dans l'industrie pétrolière, y compris dans l'extraction, la production, le raffinage et le transport de pétrole, ou dans l'extraction et la vente de charbon et la production d'électricité à partir de charbon).

En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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

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

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** »), dont les obligations vertes.

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

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent de préjudice important à aucun objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs concernant les incidences négatives sur la durabilité, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et les émissions de gaz à effet de serre.

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

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et aux armes militaires. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de sa stratégie d'exclusion et de son engagement envers les émetteurs.

— **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 :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection relative aux controverses du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs 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.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ». Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement envers les émetteurs et les exclusions.

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles [comme décrit plus haut], au secteur des armes militaires et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|--|---------------------|-------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/08/2053 | Crédit titrisé | 8,51 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % échéance 01/06/2053 | Crédit titrisé | 7,76 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % échéance 01/08/2053 | Crédit titrisé | 5,11 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % échéance 01/08/2053 | Crédit titrisé | 2,88 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 2,77 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/01/2032 | Titres liés au gouvernement américain | 2,23 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 2,08 % | États-Unis |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 5,891 % échéance 20/10/2051 | Autres instruments nets à durée courte | 1,41 % | Royaume-Uni |
| EMF-UK PLC 6,319 % échéance 13/03/2046 | Autres instruments nets à durée courte | 1,32 % | Royaume-Uni |
| TDC Net A/S 5,618 % échéance 06/02/2030 | Titres de pays développés libellés dans une devise autre que le dollar américain | 1,14 % | Danemark |
| Fannie Mae 3,500 % échéance 01/08/2059 | Crédit titrisé | 1,00 % | États-Unis |
| Great Hall Mortgages PLC 5,599 % échéance 18/06/2038 | Autres instruments nets à durée courte | 0,93 % | Royaume-Uni |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % échéance 15/01/2025 | Autres instruments nets à durée courte | 0,93 % | États-Unis |
| Ginnie Mae 5,500 % échéance 20/07/2053 | Crédit titrisé | 0,92 % | États-Unis |
| Ginnie Mae, TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | Crédit titrisé | 0,92 % | États-Unis |

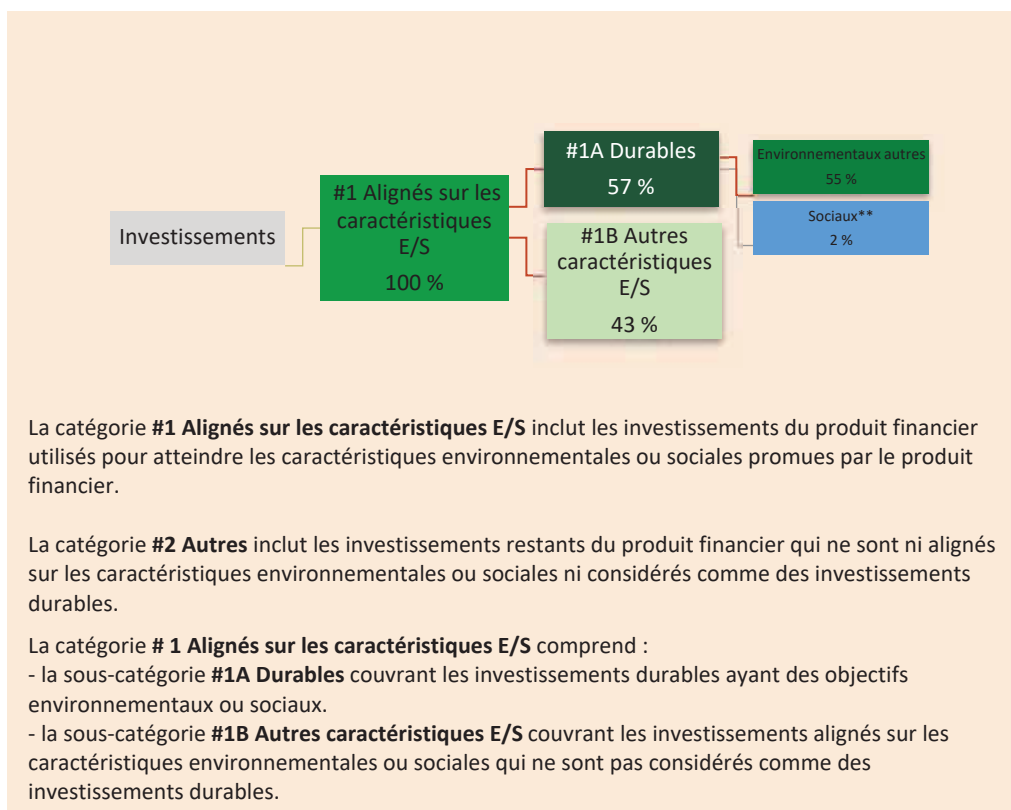
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la part du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 57 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 32 %). 55 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental (31 décembre 2022 : 30 %).

**Le Fonds détenait également 2 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social (31 décembre 2022 : 2 %). Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Crédit titrisé | 53,29 % |
| Titres liés au gouvernement américain | 27,99 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 19,03 % |
| Crédit à rendement élevé | 3,32 % |
| Marchés émergents | 2,91 % |
| Autres | 0,21 % |
| Autres instruments nets à duration courte | -0,48 % |
| Titres de pays développés libellés dans une devise autre que le dollar américain | -6,27 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● **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'UE¹ ?**



Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire



Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

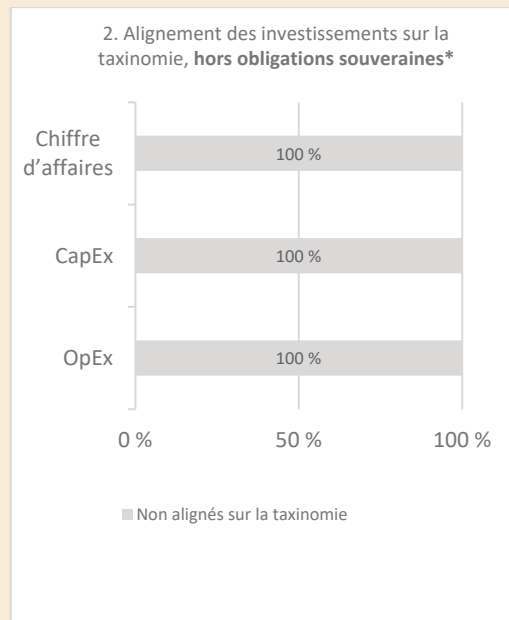
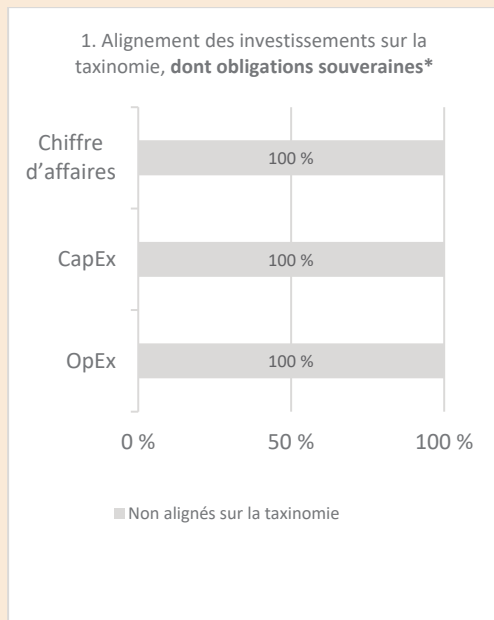
Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2023, la part des investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 55 % (31 décembre 2022 : 30 %). Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux 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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds détenait 2 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers (31 décembre 2022 : 2 %). Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Comme indiqué plus en détail ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 57 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 32 %).



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat et à la biodiversité), par exemple, en cherchant à encourager les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 : Fonds Euro Bond Fund

Identifiant d'entité juridique : U8E5120AOPVSYI2B4U46

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 taxonomie de l'UE

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

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

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales/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 taxonomie 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 taxonomie de l'UE

ayant un objectif social

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

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

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.



● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|--|----------------------------|-------------|
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF | Autres instruments nets à durée courte | 9,82 % | Irlande |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 3,07 % | États-Unis |
| Obligation internationale du gouvernement français 2,750 % échéance 25/02/2029 | Titres liés à un gouvernement | 2,99 % | France |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 2,90 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,245) % échéance 04/03/2024 | Autres instruments nets à durée courte | 2,78 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 2,55 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,216) % échéance 22/01/2024 | Autres instruments nets à durée courte | 2,20 % | Japon |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,100 % échéance 01/02/2029 | Titres liés à un gouvernement | 2,18 % | Italie |
| Obligation internationale du gouvernement français 2,500 % échéance 24/09/2026 | Titres liés à un gouvernement | 2,00 % | France |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 1,97 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,174) % échéance 18/03/2024 | Autres instruments nets à durée courte | 1,84 % | Japon |
| Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,600 % échéance 31/10/2029 | Titres liés à un gouvernement | 1,70 % | Espagne |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % échéance 15/10/2027 | Titres liés à un gouvernement | 1,58 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,206) % échéance 13/02/2024 | Autres instruments nets à durée courte | 1,28 % | Japon |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,750 % échéance 01/07/2024 | Titres liés à un gouvernement | 1,20 % | Italie |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

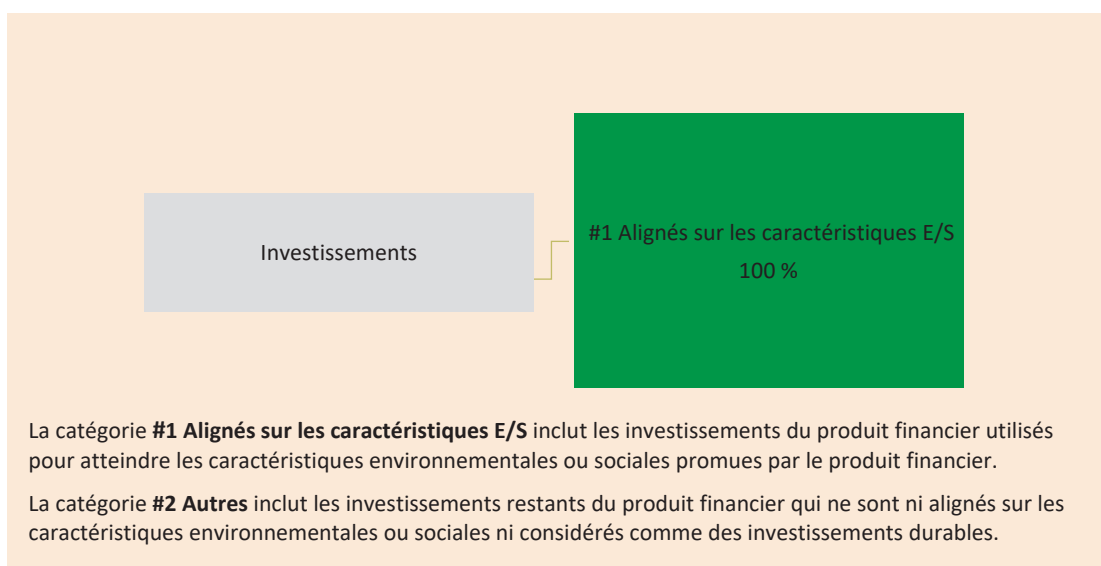


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

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



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %). Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Titres liés à un gouvernement | 66,02 % |
| Crédit titrisé | 12,81 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 11,84 % |
| Crédit à rendement élevé | 1,31 % |
| Marchés émergents | 1,88 % |
| Autres instruments nets à durée courte | 6,14 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

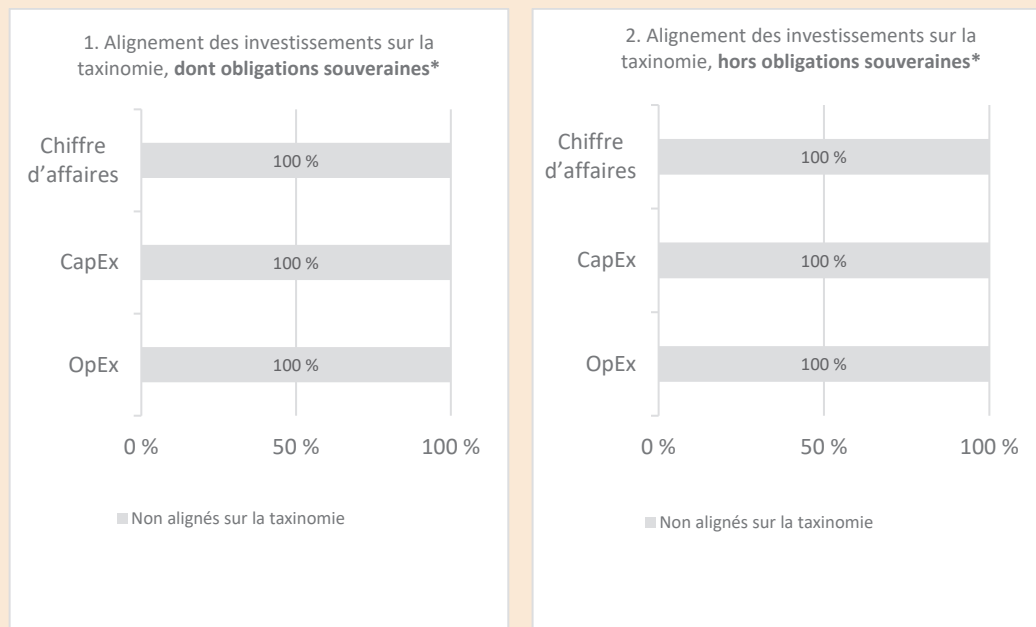
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs. (31 décembre 2022 : 100 %).

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 : Fonds Euro Credit Fund

Identifiant d'entité juridique : RJV2Q25HZY9ZSGZSMB60

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 : ___%

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales/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 ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

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 ?

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|--|---------------------|-----------------|
| Union européenne 0,000 % échéance 04/10/2030 | Titres liés à un gouvernement | 2,44 % | Supranationales |
| Fonds européen de stabilité financière 3,000 % échéance 15/12/2028 | Titres liés à un gouvernement | 2,10 % | Luxembourg |
| BNP Paribas S.A. 2,750 % échéance 25/07/2028 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,95 % | France |
| Banque européenne d'investissement 0,050 % échéance 13/10/2034 | Titres liés à un gouvernement | 1,79 % | Supranationales |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF | Autres instruments nets à durée courte | 1,77 % | Irlande |
| Union européenne 2,750 % échéance 04/02/2033 | Titres liés à un gouvernement | 1,43 % | Supranationales |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 1,37 % | États-Unis |
| Région d'Île de France 3,050 % échéance 03/02/2033 | Titres liés à un gouvernement | 1,36 % | France |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 1,26 % | États-Unis |
| BPCE S.A. 0,500 % échéance 15/09/2027 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,24 % | France |
| Union européenne 0,400 % échéance 04/02/2037 | Titres liés à un gouvernement | 1,23 % | Supranationales |
| Banque européenne d'investissement 2,250 % échéance 15/03/2030 | Titres liés à un gouvernement | 1,22 % | Supranationales |
| Association internationale de développement 1,750 % échéance 05/05/2037 | Titres liés à un gouvernement | 1,21 % | Supranationales |
| Union européenne 1,500 % échéance 04/10/2035 | Titres liés à un gouvernement | 1,21 % | Supranationales |
| Union européenne 0,450 % échéance 04/07/2041 | Titres liés à un gouvernement | 1,19 % | Supranationales |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

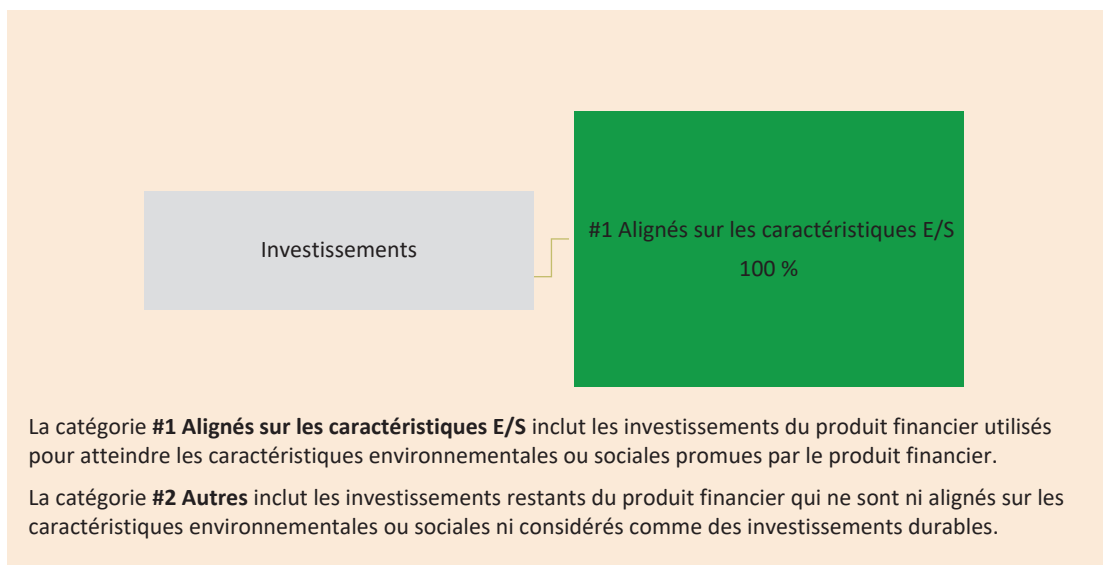
La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %). Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|---|---------------------|
| Crédit de qualité « investment grade » | 58,29 % |
| Titres liés à un gouvernement | 37,71 % |
| Crédit titrisé | 6,37 % |
| Marchés émergents | 2,11 % |
| Crédit à rendement élevé | 1,51 % |
| Autres instruments nets à duration courte | -5,99 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

- Oui :**
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non**

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

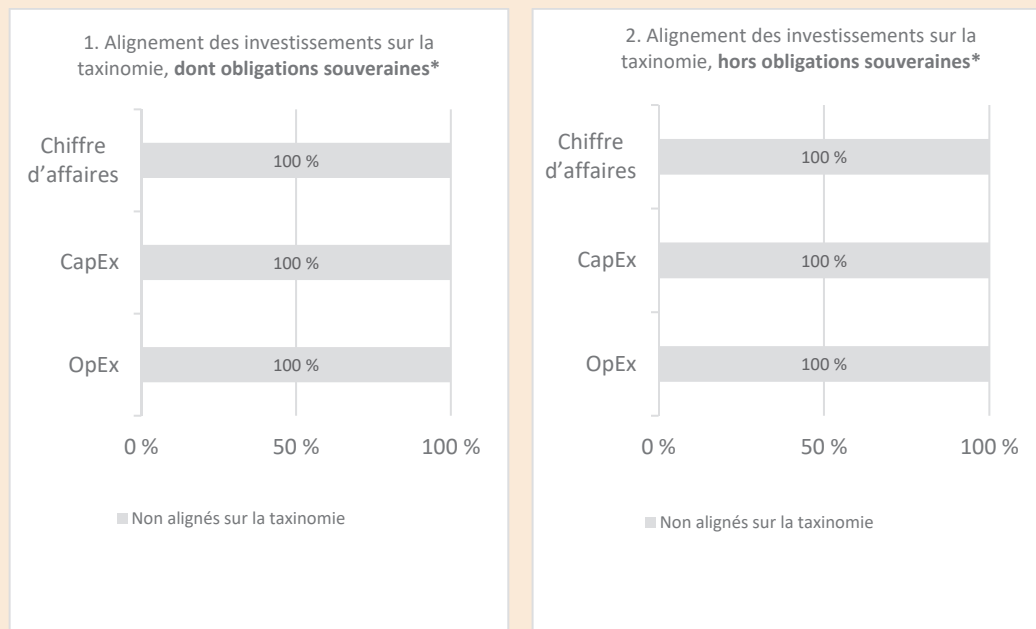
Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs. (31 décembre 2022 : 100 %).

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 : Fonds Euro Income Bond Fund

Identifiant d'entité juridique : SEK18YSZLD2OP25KSR60

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 : ___%

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales/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 ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|---|----------------------------|-------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 17,77 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2054 | Crédit titrisé | 12,01 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | Crédit titrisé | 9,81 % | États-Unis |
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF | Autres instruments nets à durée courte | 8,37 % | Irlande |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 3,70 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,271) % échéance 09/01/2024 | Autres instruments nets à durée courte | 3,38 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 2,18 % | États-Unis |
| Jupiter Mortgage PLC 6,621 % échéance 20/07/2060 | Autres instruments nets à durée courte | 2,06 % | Royaume-Uni |
| Bridgeway Funding PLC 7,470 % échéance 16/10/2062 | Autres instruments nets à durée courte | 2,02 % | Royaume-Uni |
| Barclays PLC 7,437 % échéance 02/11/2033 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,76 % | Royaume-Uni |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund | Crédit à rendement élevé | 1,22 % | Irlande |
| Bons du Trésor japonais (0,305) % échéance 09/01/2024 | Autres instruments nets à durée courte | 1,16 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % échéance 01/03/2054 | Crédit titrisé | 1,12 % | États-Unis |
| Dutch Property Finance BV 4,852 % échéance 28/04/2064 | Autres instruments nets à durée courte | 1,11 % | Pays-Bas |
| Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % échéance 21/11/2033 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,01 % | Italie |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

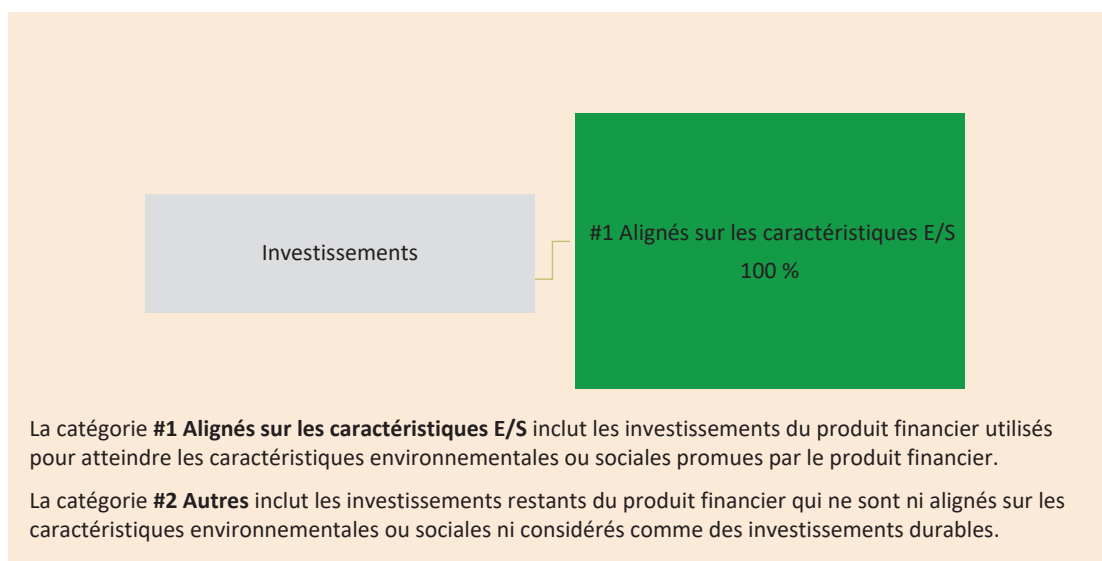


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

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



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %). Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|---|---------------------|
| Crédit titrisé | 57,62 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 25,56 % |
| Titres liés à un gouvernement | 7,37 % |
| Crédit à rendement élevé | 6,64 % |
| Marchés émergents | 5,70 % |
| Autres instruments nets à duration courte | -2,89 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

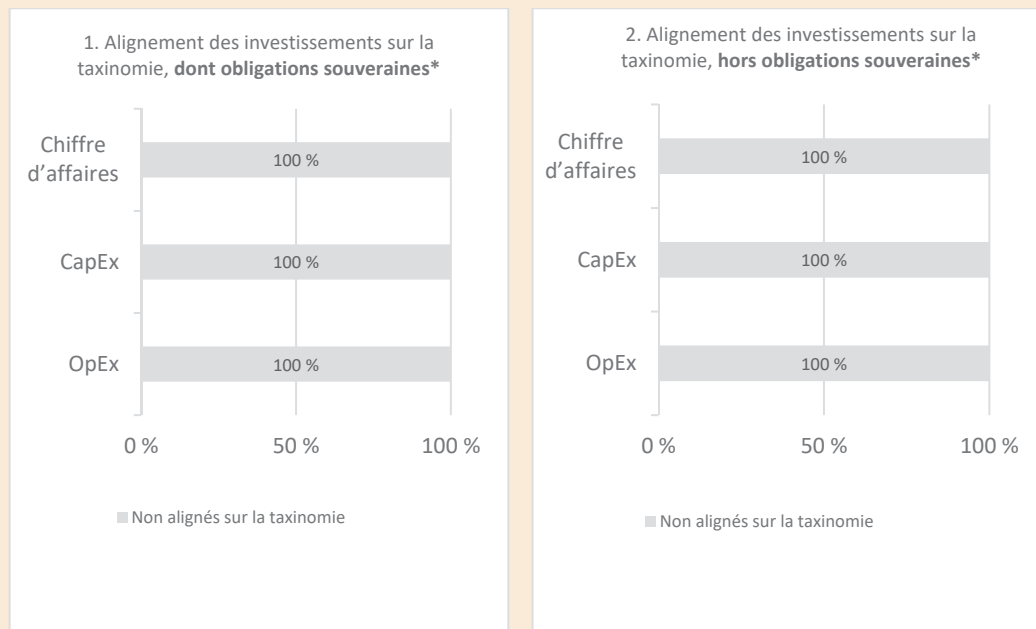
Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %).

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 : Fonds Euro Short-Term Fund

Identifiant d'entité juridique : U9SVFXJNHFFXARCR1V87

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 taxonomie de l'UE

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

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

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales/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 taxonomie 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 taxonomie de l'UE

ayant un objectif social

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

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

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.



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.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|---|---------------------|------------------|
| Bons du Trésor suisse 1,625 % échéance 29/02/2024 | Titres liés à un gouvernement | 2,11 % | Suisse |
| Bons du Trésor japonais (0,217) % échéance 19/02/2024 | Titres liés à un gouvernement | 1,76 % | Japon |
| Accunia European CLO DAC 4,863 % échéance 20/01/2031 | Crédit titrisé | 1,50 % | Irlande |
| Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos 3,875 % échéance 23/05/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,45 % | Espagne |
| Bons du Trésor français 3,867 % échéance 04/04/2024 | Titres liés à un gouvernement | 1,42 % | France |
| BNZ International Funding Ltd. 0,625 % échéance 03/07/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,34 % | Nouvelle-Zélande |
| Revocar UG 4,513 % échéance 21/04/2036 | Crédit titrisé | 1,32 % | Allemagne |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,875 % échéance 16/07/2024 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,28 % | Italie |
| Commonwealth Bank of Australia 4,928 % échéance 09/12/2026 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,22 % | Australie |
| Stratton Mortgage Funding PLC 6,069 % échéance 25/09/2051 | Crédit titrisé | 1,21 % | Royaume-Uni |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 6,690 % échéance 20/02/2045 | Crédit titrisé | 1,18 % | Royaume-Uni |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 5,891 % échéance 20/10/2051 | Crédit titrisé | 1,01 % | Royaume-Uni |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % échéance 01/10/2024 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,92 % | Danemark |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 6,220 % échéance 26/04/2024 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,90 % | Allemagne |
| Bons du Trésor japonais (0,226) % échéance 15/01/2024 | Titres liés à un gouvernement | 0,89 % | Japon |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

La liste comprend les investissements constituant la **plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

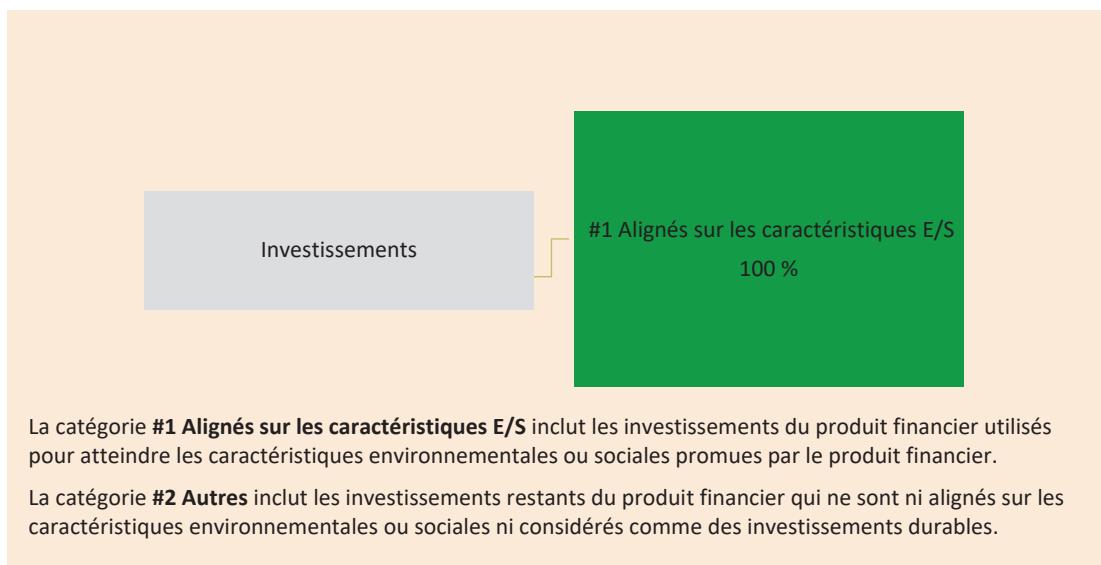


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

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



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %). Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|---|---------------------|
| Crédit de qualité « investment grade » | 52,17 % |
| Autres instruments nets à duration courte | 42,09 % |
| Crédit titrisé | 26,25 % |
| Marchés émergents | 0,18 % |
| Titres liés à un gouvernement | -20,69 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

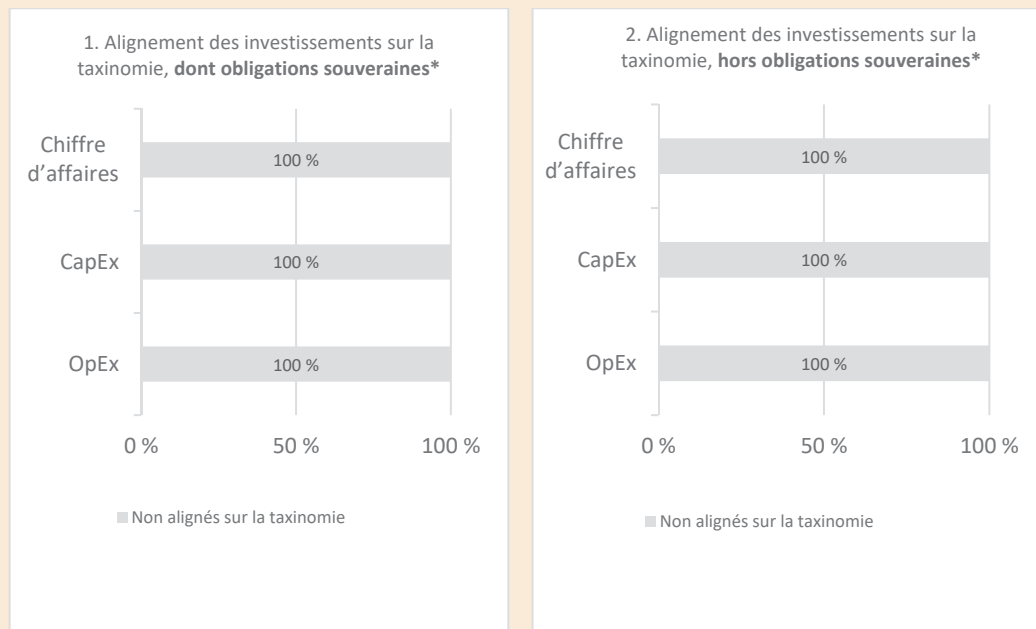
Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs. (31 décembre 2022 : 100 %).

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 :
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300HILDNB781VVQ39

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 : ___%

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales/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 ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

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 ?

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|---|---------------------|--------------------|
| PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF | Autres instruments nets à durée courte | 4,81 % | Irlande |
| Bons du Trésor du Mécanisme européen de stabilité 3,849 % échéance 23/05/2024 | Autres instruments nets à durée courte | 1,86 % | Internationales |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % échéance 31/03/2027 | Crédit à rendement élevé | 1,54 % | Pays-Bas |
| Telecom Italia SpA 7,875 % échéance 31/07/2028 | Crédit à rendement élevé | 1,45 % | Italie |
| Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % échéance 15/01/2030 | Crédit à rendement élevé | 1,38 % | Royaume-Uni |
| Forvia SE 2,750 % échéance 15/02/2027 | Crédit à rendement élevé | 1,14 % | France |
| Cirsa Finance International SARL 4,500 % échéance 15/03/2027 | Crédit à rendement élevé | 1,08 % | Luxembourg |
| AT&T, Inc. 2,875 % échéance 02/03/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 1,07 % | États-Unis |
| Nexi SpA 2,125 % échéance 30/04/2029 | Crédit à rendement élevé | 1,06 % | Italie |
| Wintershall Dea Finance BV 2,499 % échéance 20/04/2026 | Crédit à rendement élevé | 1,01 % | Pays-Bas |
| Gatwick Airport Finance PLC 4,375 % échéance 07/04/2026 | Crédit à rendement élevé | 0,96 % | Royaume-Uni |
| Grifols S.A. 3,200 % échéance 01/05/2025 | Crédit à rendement élevé | 0,96 % | Espagne |
| Verisure Holding AB 3,250 % échéance 15/02/2027 | Crédit à rendement élevé | 0,94 % | Suède |
| Électricité de France S.A. 2,875 % échéance 15/12/2026 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,91 % | France |
| EP Infrastructure A/S 1,816 % échéance 02/03/2031 | Crédit de qualité « investment grade » | 0,91 % | République tchèque |

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

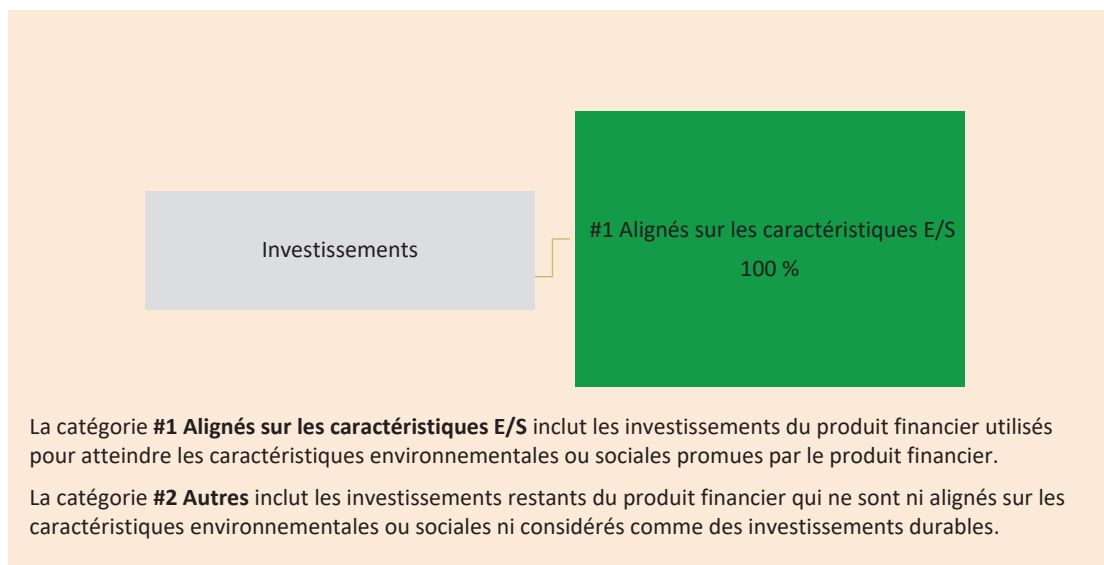
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|---|---------------------|
| Crédit à rendement élevé | 72,33 % |
| Titres liés à un gouvernement | 20,87 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 18,25 % |
| Marchés émergents | 0,32 % |
| Autres instruments nets à duration courte | -11,77 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

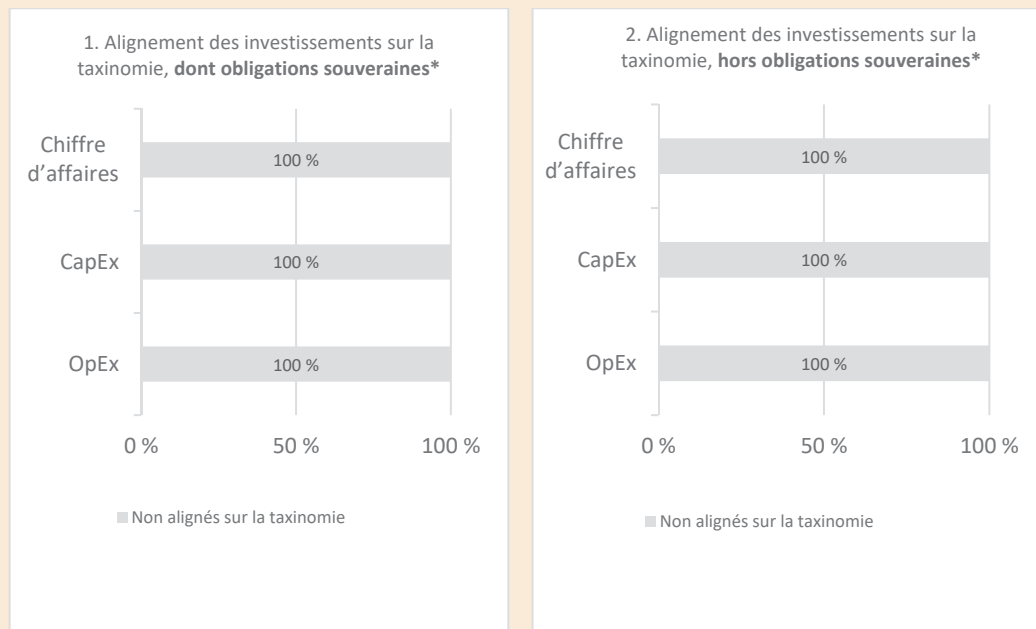
Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 :
Fonds Global Bond ESG Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300PFJAUUMMOPU079

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 taxonomie de l'UE

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

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

Non

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 18 % 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 taxonomie 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 taxonomie de l'UE

ayant un objectif social**

**Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature

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 ?

L'approche du Fonds en matière de durabilité passe par la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et/ou d'atténuation du changement climatique.

Les produits dérivés (à l'exception des produits dérivés sur indice) détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la stratégie d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds.

● *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?*

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** ») qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles (y compris les émetteurs principalement actifs dans l'industrie pétrolière, y compris dans l'extraction, la production, le raffinage et le transport de pétrole, ou dans l'extraction et la vente de charbon et la production d'électricité à partir de charbon).

En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

● *...et par rapport aux périodes précédentes ?*

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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

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

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « Titres ESG à revenu fixe »), dont les obligations vertes.

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

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent de préjudice important à aucun objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs concernant les incidences négatives sur la durabilité, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et les émissions de gaz à effet de serre.

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

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et aux armes militaires. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de sa stratégie d'exclusion et de son engagement envers les émetteurs.

— **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 :**

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection relative aux controverses du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs 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.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ». Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement envers les émetteurs et les exclusions.

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles [comme décrit plus haut], au secteur des armes militaires et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|---|---------------------|------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 9,20 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,253) % échéance 26/02/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 5,19 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 3,70 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,245) % échéance 04/03/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 2,96 % | Japon |
| Bons du Trésor japonais (0,216) % échéance 22/01/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 2,29 % | Japon |
| Bons du Trésor japonais (0,211) % échéance 29/01/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 2,22 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 1,79 % | États-Unis |
| Bons du Trésor japonais (0,225) % échéance 26/02/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 1,48 % | Japon |
| République d'Allemagne 0,000 % échéance 15/08/2031 | Titres liés à un gouvernement | 1,45 % | Allemagne |

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



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|---|---------------------|------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/04/2053 | Crédit titrisé | 1,39 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % échéance 01/10/2052 | Crédit titrisé | 1,36 % | États-Unis |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % échéance 01/10/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 1,36 % | Japon |
| Bons du Trésor japonais (0,271) % échéance 09/01/2024 | Autres instruments nets à duration courte | 1,35 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % échéance 01/05/2053 | Crédit titrisé | 1,29 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2054 | Crédit titrisé | 1,13 % | États-Unis |

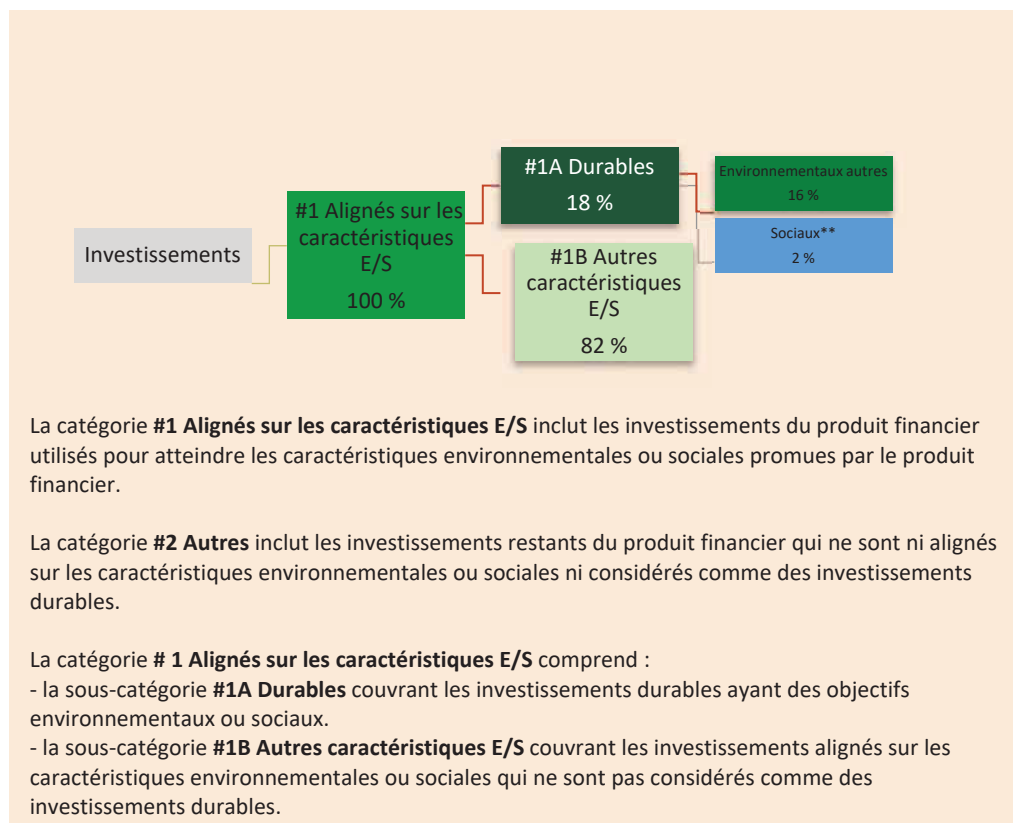
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la part du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 18 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 15 %). 16 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental (31 décembre 2022 : 14 %).

**Le Fonds détenait également 2 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social (31 décembre 2022 : 1 %). Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Titres liés à un gouvernement | 52,34 % |
| Crédit titrisé | 31,33 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 13,30 % |
| Titres liés à l'inflation | 4,05 % |
| Dette extérieure des Marchés émergents | 3,64 % |
| Obligations couvertes et Pfandbriefe | 2,00 % |
| Autres | 0,17 % |
| Titres municipaux | 0,10 % |
| Dette locale des Marchés émergents | -0,71 % |
| Autres instruments nets à durée courte | -6,22 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

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

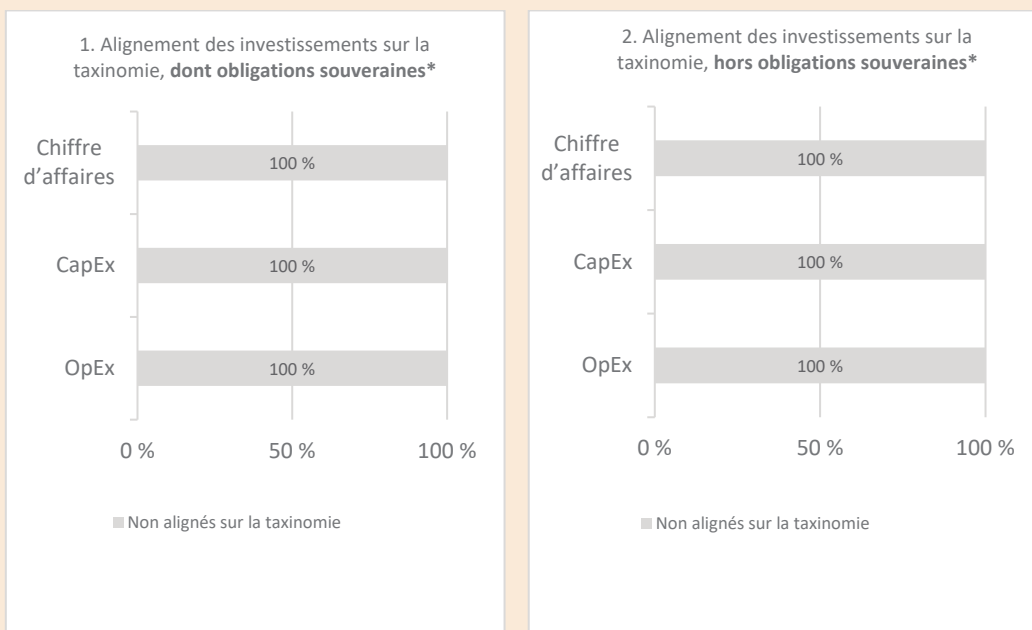
Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

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.

● **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'UE¹ ?**

- Oui :**
- Dans le gaz fossile
- 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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



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



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

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2023, la part des investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 16 % (31 décembre 2022 : 14 %). Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



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

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds détenait 2 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers (31 décembre 2022 : 1 %). Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Comme indiqué plus en détail ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 18 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 15 %).



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat et à la biodiversité), par exemple, en cherchant à encourager les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

O ANNEXE IV

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 :
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493005HZUTWLN5JSJ59

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.

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

| Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ? | |
|--|---|
| ●● <input type="checkbox"/> Oui | ●● <input checked="" type="checkbox"/> Non |
| <input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE | <input checked="" type="checkbox"/> 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 57 % d'investissements durables <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> 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 <input checked="" type="checkbox"/> 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 <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif social** |
| <input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___% | <input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables |

**Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature



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

L'approche du Fonds en matière de durabilité passe par la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et/ou d'atténuation du changement climatique.

Les produits dérivés (à l'exception des produits dérivés sur indice) détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la stratégie d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds.

● *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?*

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** ») qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles (y compris les émetteurs principalement actifs dans l'industrie pétrolière, y compris dans l'extraction, la production, le raffinage et le transport de pétrole, ou dans l'extraction et la vente de charbon et la production d'électricité à partir de charbon).

En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

● *...et par rapport aux périodes précédentes ?*

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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

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

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « Titres ESG à revenu fixe »), dont les obligations vertes.

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

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent de préjudice important à aucun objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs concernant les incidences négatives sur la durabilité, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et les émissions de gaz à effet de serre.

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

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et aux armes militaires. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de sa stratégie d'exclusion et de son engagement envers les émetteurs.

— **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 :**

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection relative aux controverses du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs 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.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ». Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement envers les émetteurs et les exclusions.

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles [comme décrit plus haut], au secteur des armes militaires et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|-------------------------------|---------------------|-----------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 5,22 % | États-Unis |
| Obligations du Trésor américain 2,375 % échéance 15/02/2042 | Titres liés à un gouvernement | 2,08 % | États-Unis |
| Obligations du Trésor américain 4,750 % échéance 15/11/2043 | Titres liés à un gouvernement | 1,67 % | États-Unis |
| Obligations du Trésor américain 3,250 % échéance 15/05/2042 | Titres liés à un gouvernement | 1,57 % | États-Unis |
| Billets du Trésor américain 4,250 % échéance 31/05/2025 | Titres liés à un gouvernement | 1,41 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/07/2032 | Titres liés à un gouvernement | 1,34 % | États-Unis |
| Obligations du Trésor américain 2,000 % échéance 15/11/2041 | Titres liés à un gouvernement | 1,32 % | États-Unis |
| Union européenne 2,750 % échéance 04/12/2037 | Titres liés à un gouvernement | 1,26 % | Supranationales |
| Obligations du Trésor américain 4,000 % échéance 15/11/2042 | Titres liés à un gouvernement | 1,24 % | États-Unis |

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|-------------------------------|---------------------|------------|
| Obligations du Trésor américain 2,250 % échéance 15/05/2041 | Titres liés à un gouvernement | 1,02 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 0,94 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/07/2053 | Crédit titrisé | 0,90 % | États-Unis |
| BNG Bank NV 3,250 % échéance 29/08/2033 | Titres liés à un gouvernement | 0,75 % | Pays-Bas |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2054 | Crédit titrisé | 0,61 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % échéance 15/07/2033 | Titres liés à un gouvernement | 0,56 % | États-Unis |

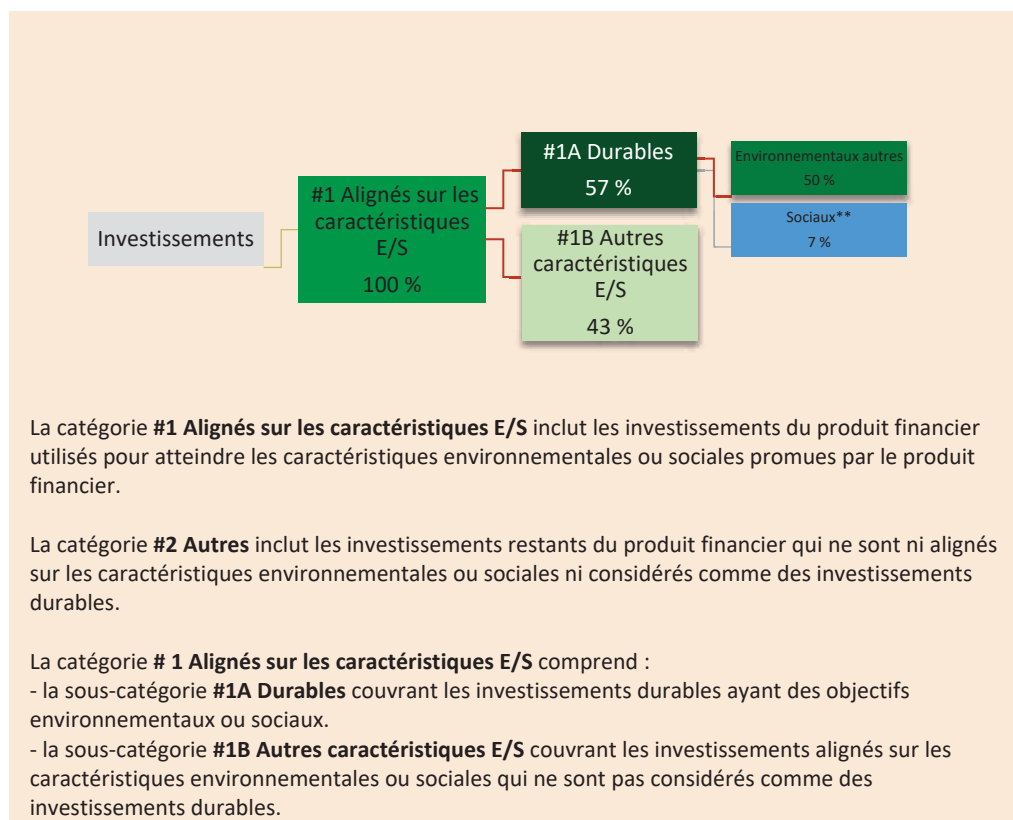
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la part du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



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.

Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 57 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 60 %). 50 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental (31 décembre 2022 : 55 %).

**Le Fonds détenait également 7 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social (31 décembre 2022 : 5 %). Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|---|---------------------|
| Crédit de qualité « investment grade » | 67,29 % |
| Titres liés à un gouvernement | 28,55 % |
| Crédit titrisé | 11,45 % |
| Crédit à rendement élevé | 2,21 % |
| Marchés émergents | 1,96 % |
| Municipal/autre | 0,22 % |
| Autres instruments nets à duration courte | -11,68 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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

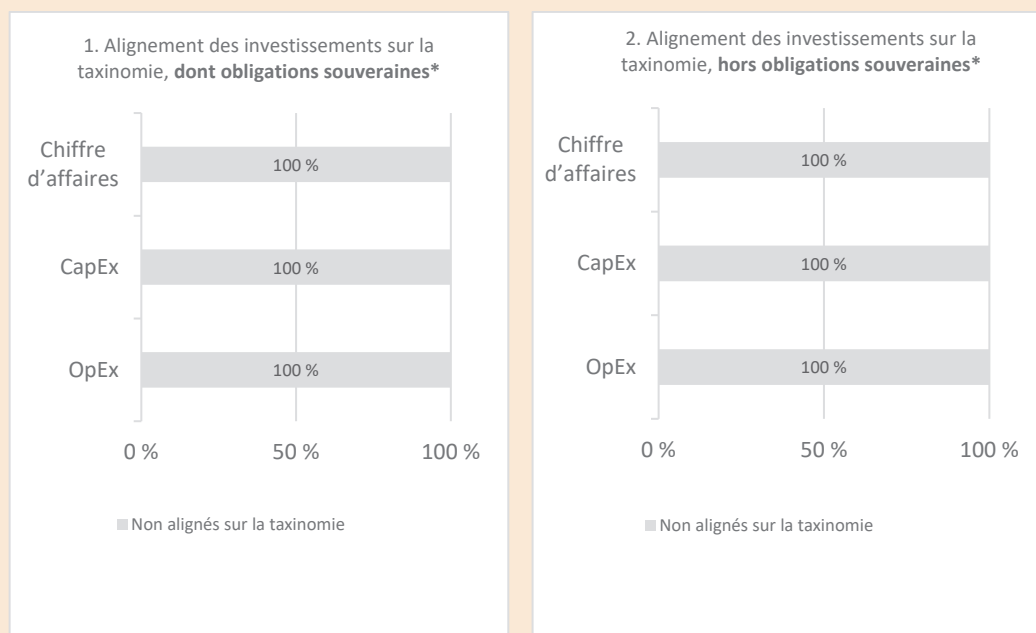
Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

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.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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



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

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2023, la part des investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 50 % (31 décembre 2022 : 55 %). Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



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

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds détenait 7 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers (le chiffre au 31 décembre 2022 était de 5 %). Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Comme indiqué plus en détail ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 57 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 60 %).



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat et à la biodiversité), par exemple, en cherchant à encourager les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 :
Fonds Global Low Duration Real Return Fund

Identifiant d'entité juridique :
5493004EUSX3DN7B3B79

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 taxonomie de l'UE

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

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

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales/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 taxonomie 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 taxonomie de l'UE

ayant un objectif social

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

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

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.



● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|--|----------------------------|-------------|
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % échéance 15/01/2028 | Titres liés à l'inflation | 8,69 % | États-Unis |
| Bon du Trésor britannique 1,250 % échéance 22/11/2027 | Titres liés à l'inflation | 6,93 % | Royaume-Uni |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % échéance 15/01/2025 | Autres instruments nets à durée courte | 6,07 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/07/2026 | Titres liés à l'inflation | 5,85 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/10/2026 | Titres liés à l'inflation | 5,74 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % échéance 15/01/2027 | Titres liés à l'inflation | 5,67 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/01/2026 | Titres liés à l'inflation | 5,46 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % échéance 15/10/2027 | Titres liés à l'inflation | 5,43 % | États-Unis |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % échéance 15/09/2024 | Titres liés à l'inflation | 5,40 % | Italie |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % échéance 15/07/2025 | Titres liés à l'inflation | 4,83 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/10/2024 | Autres instruments nets à durée courte | 4,76 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 4,63 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2025 | Titres liés à l'inflation | 4,54 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % échéance 15/01/2029 | Titres liés à l'inflation | 4,40 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2026 | Titres liés à l'inflation | 4,37 % | États-Unis |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

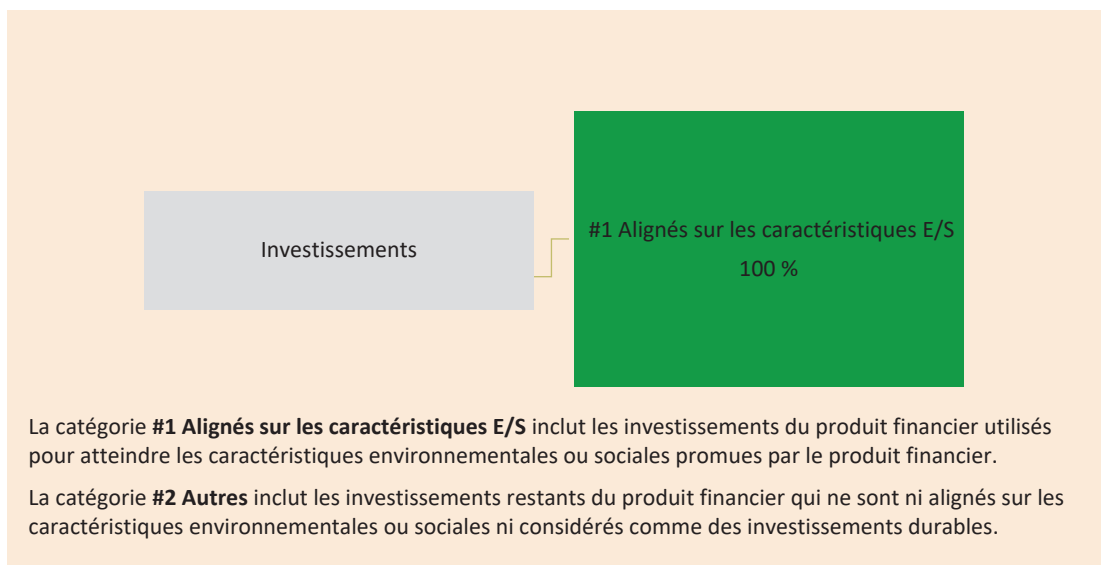


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

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



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %). Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Titres liés à l'inflation | 108,39 % |
| Crédit titrisé | 11,69 % |
| Obligations couvertes et Pfandbriefe | 2,95 % |
| Autres instruments nets à durée courte | 2,79 % |
| Dettes locales des Marchés émergents | 0,25 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 0,08 % |
| Crédit à rendement élevé | 0,05 % |
| Titres liés à un gouvernement | -26,20 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

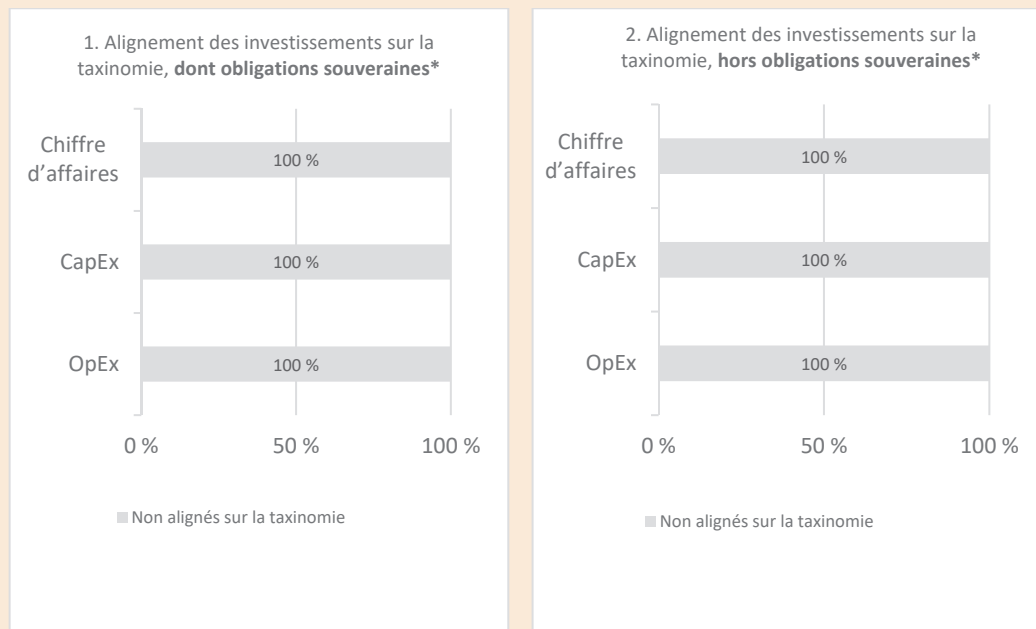
Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs. (31 décembre 2022 : 100 %).

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 : Fonds Global Real Return Fund Identifiant d'entité juridique : TJC21SOQHOBNO288A280

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 taxonomie de l'UE

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

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

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales/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 taxonomie 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 taxonomie 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 ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales en appliquant une stratégie d'exclusion. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales en s'engageant activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (des exemples de cet engagement incluaient les questions importantes liées au climat), notamment en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa stratégie d'exclusion, ainsi que de sa politique d'engagement envers les émetteurs. La stratégie d'exclusion du Fonds s'applique à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués principalement dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, selon le cas.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|-------------------------------|----------------------------|-------------|
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/07/2031 | Titres liés à l'inflation | 7,10 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % échéance 15/01/2028 | Titres liés à l'inflation | 4,20 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 4,01 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2025 | Titres liés à l'inflation | 3,24 % | États-Unis |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % échéance 26/05/2025 | Titres liés à l'inflation | 3,20 % | Italie |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % échéance 15/10/2027 | Titres liés à l'inflation | 3,17 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/07/2032 | Titres liés à l'inflation | 3,02 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % échéance 15/07/2029 | Titres liés à l'inflation | 2,88 % | États-Unis |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % échéance 15/05/2028 | Titres liés à l'inflation | 2,75 % | Italie |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 2,51 % | États-Unis |
| Bon du Trésor britannique 1,250 % échéance 22/11/2032 | Titres liés à l'inflation | 2,39 % | Royaume-Uni |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,125 % échéance 10/10/2028 | Titres liés à un gouvernement | 2,38 % | Allemagne |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/01/2030 | Titres liés à l'inflation | 2,32 % | États-Unis |
| Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % échéance 10/03/2029 | Titres liés à l'inflation | 2,32 % | Japon |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2026 | Titres liés à l'inflation | 2,27 % | États-Unis |

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

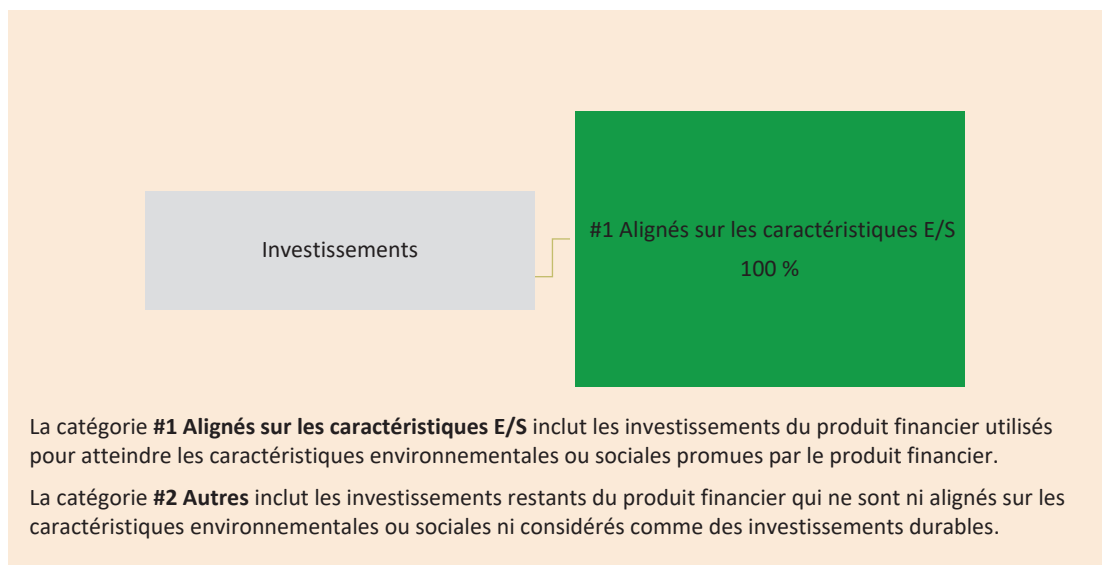
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs (31 décembre 2022 : 100 %). Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|---|---------------------|
| Titres liés à l'inflation | 108,31 % |
| Crédit titrisé | 14,16 % |
| Autres instruments nets à duration courte | 4,35 % |
| Obligations couvertes et Pfandbriefe | 2,71 % |
| Dette locale des Marchés émergents | 0,24 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 0,16 % |
| Crédit à rendement élevé | 0,04 % |
| Dette extérieure des Marchés émergents | 0,01 % |
| Titres liés à un gouvernement | -29,98 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisées.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Pour être conformes à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 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 de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

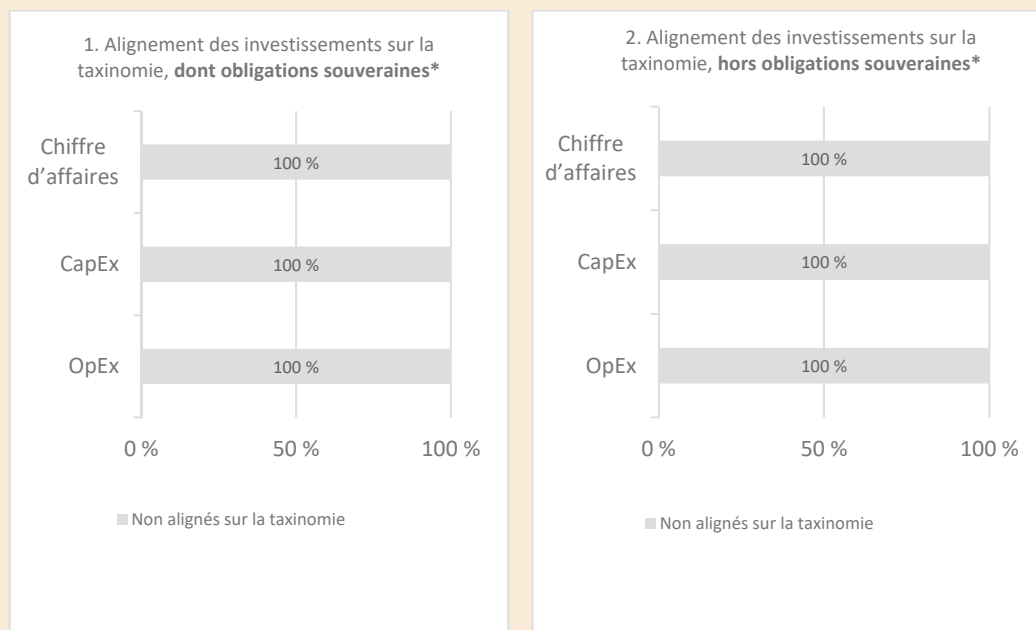
Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car la stratégie d'exclusion du Fonds a été appliquée à tous ses investissements directs. (31 décembre 2022 : 100 %).

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat), par exemple, en encourageant les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

ANNEXE IV

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 :
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

Identifiant d'entité juridique :
549300M7ZPBX56GB2C41

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

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 taxonomie de l'UE

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

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

Non

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 60 % 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 taxonomie 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 taxonomie de l'UE

ayant un objectif social**

**Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature

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 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 ?

L'approche du Fonds en matière de durabilité passe par la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et/ou d'atténuation du changement climatique.

Les produits dérivés (à l'exception des produits dérivés sur indice) détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la stratégie d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds a été mesurée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** ») qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, la stratégie d'exclusion du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles (y compris les émetteurs principalement actifs dans l'industrie pétrolière, y compris dans l'extraction, la production, le raffinage et le transport de pétrole, ou dans l'extraction et la vente de charbon et la production d'électricité à partir de charbon).

En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Des informations sur la comparaison historique des investissements du Fonds liés à la durabilité sont disponibles ci-dessous en réponse à la question « *Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?* ».

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

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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs 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.

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée « **Titres ESG à revenu fixe** »), dont les obligations vertes.

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

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent de préjudice important à aucun objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs concernant les incidences négatives sur la durabilité, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et les émissions de gaz à effet de serre.

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

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles (comme décrit plus haut) et aux armes militaires. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de sa stratégie d'exclusion et de son engagement envers les émetteurs.

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 :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection relative aux controverses du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



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

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ». Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement envers les émetteurs et les exclusions.

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles [comme décrit plus haut], au secteur des armes militaires et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|---|---|---------------------|-------------|
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/10/2053 | Crédit titrisé | 18,83 % | États-Unis |
| Billets du Trésor américain 5,000 % échéance 30/09/2025 | Titres liés à un gouvernement | 7,75 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/05/2053 | Crédit titrisé | 7,57 % | États-Unis |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,500 % échéance 09/03/2028 | Crédit de qualité « investment grade » | 3,93 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,500 % échéance 01/02/2054 | Crédit titrisé | 3,88 % | États-Unis |
| NatWest Group PLC 4,067 % échéance 06/09/2028 | Crédit de qualité « investment grade » | 2,16 % | Royaume-Uni |
| Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % échéance 05/09/2027 | Crédit de qualité « investment grade » | 2,13 % | Japon |
| St. Paul's CLO DAC 4,715 % échéance 15/01/2032 | Autres instruments nets à duration courte | 2,08 % | Irlande |

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : au 31 décembre 2023.

| Investissements les plus importants | Secteur | En % de l'actif net | Pays |
|--|---|---------------------|------------|
| Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % échéance 07/10/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 2,01 % | Japon |
| NTT Finance Corp. 0,082 % échéance 13/12/2025 | Crédit de qualité « investment grade » | 2,00 % | Japon |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % échéance 01/10/2053 | Crédit titrisé | 1,90 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % échéance 15/07/2033 | Titres liés à l'inflation | 1,89 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % échéance 15/01/2033 | Titres liés à l'inflation | 1,88 % | États-Unis |
| Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/07/2032 | Titres liés à l'inflation | 1,86 % | États-Unis |
| Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % échéance 01/08/2053 | Crédit titrisé | 1,85 % | États-Unis |

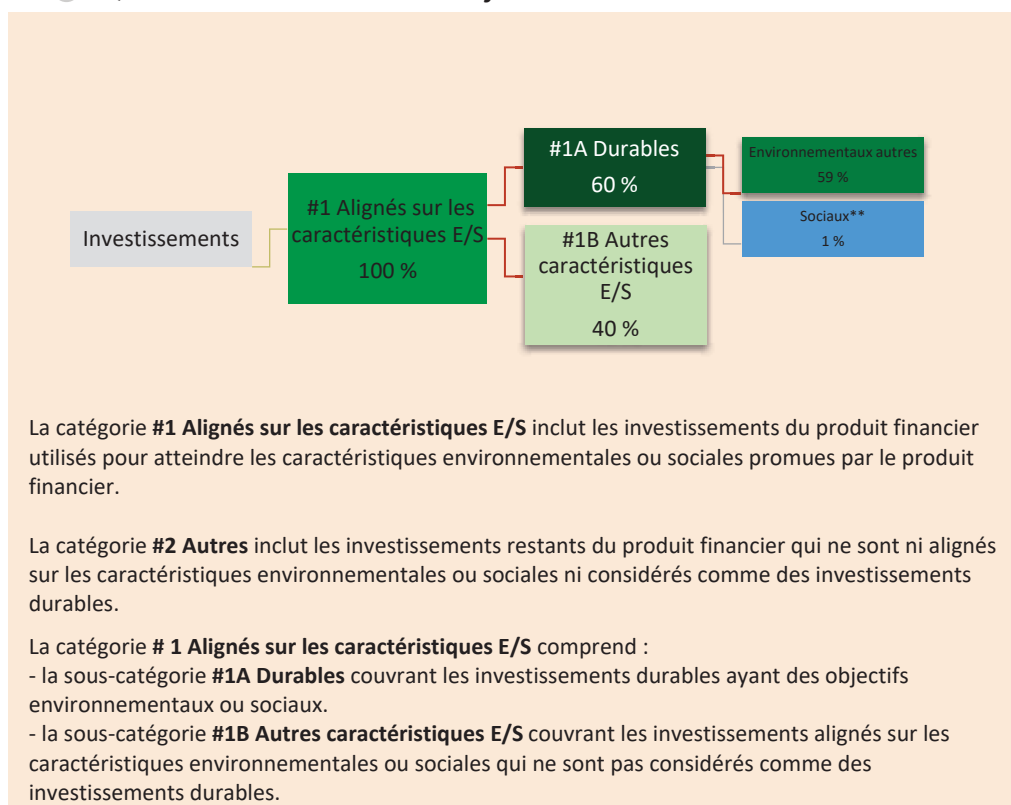
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Des informations sur la part du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la part du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2023 sont fournies ci-dessous.

● Quelle était l'allocation des actifs ?



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

Au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 60 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 29 %). 59 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental (31 décembre 2022 : 28 %).

**Le Fonds détenait également 1 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social (31 décembre 2022 : 1 %). Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

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

| Secteur | En % de l'actif net |
|--|---------------------|
| Crédit titrisé | 35,24 % |
| Crédit de qualité « investment grade » | 34,35 % |
| Autres instruments nets à durée courte | 33,25 % |
| Titres liés à l'inflation | 5,63 % |
| Crédit à rendement élevé | 2,05 % |
| Dettes extérieures des Marchés émergents | 0,01 % |
| Titres liés à un gouvernement | -10,53 % |

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2023 ont été utilisés.



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

Au 31 décembre 2023, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE est de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %). Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un commissaire aux comptes et n'a pas été examiné par un tiers.

● 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'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non

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 climatique ») 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 taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

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

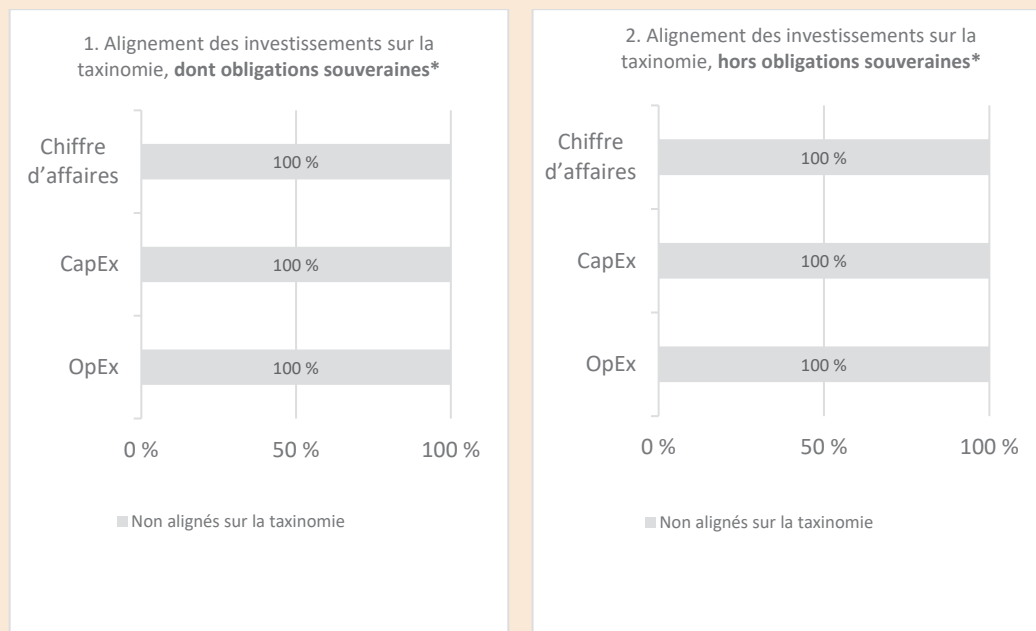
Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

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.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

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 les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, 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

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

Au 31 décembre 2023, la part des investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 % (31 décembre 2022 : 0 %).



Le symbole

représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



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

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2023, la part des investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 59 % (31 décembre 2022 : 28 %). Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



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

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds détenait 1 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers (le chiffre au 31 décembre 2022 était de 1 %). Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.



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 ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2023, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et/ou sociales, car tous les investissements du Fonds (à l'exception des produits dérivés sur indice) ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion (31 décembre 2022 : 100 %).

Comme indiqué plus en détail ci-dessus, au 31 décembre 2023, le Fonds a investi 60 % de son actif net dans des investissements durables (31 décembre 2022 : 29 %).



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

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé activement auprès de certains émetteurs, le cas échéant (cet engagement incluait notamment des sujets importants liés au climat et à la biodiversité), par exemple, en cherchant à encourager les émetteurs à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leur engagement en matière de durabilité.

Glossaire : (abréviations éventuellement utilisées dans les états qui précèdent)

Abréviations des contreparties :

| | | | | | |
|------------|--|-------------|--|------------|--|
| AZD | Australia and New Zealand Banking Group | CSN | Credit Suisse AG (New York) | MEI | Merrill Lynch International |
| BOA | Bank of America N.A. | DBL | Deutsche Bank AG London | MSC | Morgan Stanley & Co. LLC. |
| BOM | Bank of Montreal | DEU | Deutsche Bank Securities, Inc. | MYC | Morgan Stanley Capital Services LLC |
| BOS | BofA Securities, Inc. | DUB | Deutsche Bank AG | MYI | Morgan Stanley & Co. International PLC |
| BPG | BNP Paribas Securities Corp. | FAR | Wells Fargo Bank National Association | NGF | Nomura Global Financial Products, Inc. |
| BPS | BNP Paribas S.A. | FBF | Credit Suisse International | NOM | Nomura Securities International, Inc. |
| BRC | Barclays Bank PLC | FCT | Credit Suisse Capital LLC | RBC | Royal Bank of Canada |
| BSH | Banco Santander S.A. - Succursale de New York | FICC | Fixed Income Clearing Corporation | RCY | Royal Bank of Canada |
| BSN | The Bank of Nova Scotia - Toronto | GLM | Goldman Sachs Bank USA | RCE | Royal Bank of Canada Europe Limited |
| BSS | Banco Santander S.A. | GRE | NatWest Markets Securities, Inc. | RYL | NatWest Markets Plc |
| BYL | Barclays Bank PLC, succursale de Londres | GSC | Goldman Sachs & Co. LLC | SAL | Citigroup Global Markets, Inc. |
| BYR | The Bank of Nova Scotia - Toronto | GST | Goldman Sachs International | SCX | Standard Chartered Bank, Londres |
| CBK | Citibank N.A. | HUS | HSBC Bank USA N.A. | SGY | Société Générale, NY |
| CDI | Natixis Singapore | IND | Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A. | SOG | Société Générale Paris |
| CEW | Canadian Imperial Bank of Commerce World Markets | JLN | JP Morgan Chase Bank N.A. Londres | SSB | State Street Bank and Trust Co. |
| CIB | Canadian Imperial Bank of Commerce | JML | JP Morgan Securities Plc | STR | State Street FICC Repo |
| CKL | Citibank N.A. Londres | JPM | JP Morgan Chase Bank N.A. | TDM | TD Securities (USA) LLC |
| CLY | Credit Agricole Corporate and Investment Bank | JPS | J.P. Morgan Securities LLC | TOR | The Toronto-Dominion Bank |
| COM | Commerz Bank AG | MAC | Macquarie Bank Limited | UAG | UBS AG Stamford |
| | | MBC | HSBC Bank Plc | UBS | UBS Securities LLC |
| | | | | WFS | Wells Fargo Securities, LLC |

Abréviations des devises :

| | | | | | |
|-------------------|---------------------------------------|-------------------|----------------------|--------------------|-----------------------|
| AED | Dirham des EAU | HKD | Dollar de Hong Kong | QAR | Riyal du Qatar |
| ARS | Peso argentin | HUF | Forint hongrois | RON | Nouveau leu roumain |
| AUD | Dollar australien | IDR | Roupie indonésienne | RSD | Dinar serbe |
| BRL | Réal brésilien | ILS | Shekel israélien | RUB | Rouble russe |
| CAD | Dollar canadien | INR | Roupie indienne | SEK | Couronne suédoise |
| CHF | Franc suisse | JPY (ou ¥) | Yen japonais | SGD | Dollar de Singapour |
| CLP | Peso chilien | KES | Shilling kényan | THB | Baht thaïlandais |
| CNH | Renminbi chinois (Offshore) | KRW | Won sud-coréen | TRY | Nouvelle livre turque |
| CNY | Renminbi chinois (Chine continentale) | KZT | Tenge kazakh | TWD | Dollar de Taiwan |
| COP | Peso colombien | MXN | Peso mexicain | UGX | Shilling ougandais |
| CZK | Couronne tchèque | MYR | Ringgit malaisien | USD (ou \$) | Dollar américain |
| DKK | Couronne danoise | NGN | Naira nigérian | UYU | Peso uruguayen |
| DOP | Peso dominicain | NOK | Couronne norvégienne | VND | Dong vietnamien |
| EGP | Livre égyptienne | NZD | Dollar néo-zélandais | ZAR | Rand sud-africain |
| EUR (ou €) | Euro | PEN | Nouveau Sol péruvien | ZMW | Kwacha zambien |
| GBP (ou £) | Livre sterling | PHP | Peso philippin | | |
| GHS | Cedi ghanéen | PLN | Zloty polonais | | |

Abréviations des marchés de change :

| | | | | | |
|-------------|--------------------------------|--------------|--------------------------------|-------------------------|---------------------------|
| BIST | Borsa Istanbul Exchange | EUREX | Eurex Exchange | ICE | IntercontinentalExchange® |
| CBOE | Chicago Board Options Exchange | FTSE | Financial Times Stock Exchange | Marché hors cote | Marché hors cote |

Abréviations des indices/spread :

| | | | | | |
|------------------|---|-----------------|--|--------------------------|--|
| ABX.HE | Indice Asset-Backed Securities Index – Home Equity | CPTFEMU | Indice Eurozone HICP ex-Tobacco Index | PrimeX.ARM | Indice Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage |
| | | CPURNSA | Indice Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index | 500 S&P | Indice Standard & Poor's 500 Index |
| ACS | Indice Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index | DAX | Indice Deutscher Aktien Index 30 | S&P CNX Nifty | Indice Standard & Poor's Nifty 50 Index |
| AMNAX | Indice Alerian Midstream Energy Total Return Index | FRCPXTOB | Indice France Consumer Price ex-Tobacco Index | SARON | Taux au jour le jour moyen en franc suisse |
| | | FTSE/JSE | Indice South African Performance Index | SPSIHOTR | Indice S&P Homebuilders Select Industry Index (TR) |
| BCOMF1TC | Indice Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return | FTSE/MIB | Indice Borsa Italiana's 40 Most Liquid/Capitalised Italian Shares Equity Index | SIBCSORA | Taux moyen au jour le jour de Singapour |
| | | IBEX 35 | Indice Spanish Continuous Exchange Index | SOFR | Secured Overnight Financing Rate (Taux de financement au jour le jour garanti) |
| BCOMTR | Indice Bloomberg Commodity Index Total Return | IBR | Indicador Bancario de Referencia | SONIA | Sterling Overnight Index Average (Indice moyen au jour le jour en livre sterling) |
| BCOMTR1 | Indice Bloomberg Custom Commodity Index | IXUTR | Indice Utilities Select Sector Total Return Index | SONIO | Sterling Overnight Interbank Average Rate (Taux moyen interbancaire au jour le jour en livre sterling) |
| BOVESPA | Indice Brazil Bovespa Index | JMABDEWU | Indice J.P. Morgan Custom Commodity Index | SORA | Taux moyen au jour le jour de Singapour |
| | | JMABNIU5 | Indice J.P. Morgan Custom Commodity Index | SPI 200 | Indice Australian Equity Futures Index |
| CAC | Cotation Assistée en Continu | KOSPI | Indice Korea Composite Stock Price Index | SRFXON3 | Taux moyen au jour le jour de Suisse (18 h) |
| CAONREPO | Taux moyen des mises en pension au jour le jour canadien | KOSPI2 | Indice Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index | SET 50 | Indice Thailand Equity Index |
| CDX.EM | Indice Credit Derivatives Index - Emerging Markets | MUTKCALM | Tokyo Overnight Average Rate (Taux moyen au jour le jour à Tokyo) | SRFXON3 | Taux moyen au jour le jour de Suisse (18 h) |
| CDX.HY | Indice Credit Derivatives Index - High Yield | NASDAQ | NASDAQ (National Association of Securities Dealers Automated Quotations) | TOPIX | Indice Tokyo Price Index |
| CDX.IG | Indice Credit Derivatives Index - Investment Grade | NDUEACWF | Indice MSCI ACWI Index Future | TRNGLU | Indice FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD |
| | | OMXS30 | Indice Stockholm 30 Index | IPC Royaume-Uni | Indice United Kingdom Retail Prices Index |
| CIXBSTR3 | Indice Custom Commodity Index | PIMCODBU | PIMCO Custom Commodity Basket | VSTOXX | Indice Euro Stoxx 50 Volatility Index |
| CMBX | Indice Commercial Mortgage-Backed Index | | | WIG20 | Indice boursier pondéré par la capitalisation des 20 plus grandes entreprises de la Bourse de Varsovie |
| CNREPOFIX | Taux des prises en pension de Chine à 7 jours | | | | |
| CPALEMU | Indice Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index | | | | |

Abréviations des obligations municipales ou des Agences :

| | | | |
|------------|----------------------------|-----------|------|
| AGM | Assured Guaranty Municipal | ST | État |
|------------|----------------------------|-----------|------|

Autres abréviations :

| | | | | | |
|-----------------|---|----------------|--|-------------------|--|
| ABS | Titre adossé à des actifs | HIBOR | Taux interbancaire offert à Hong Kong | RMBS | Titre adossé à des créances hypothécaires résidentielles |
| ALT | Alternate Loan Trust | JIBAR | Taux interbancaire convenu à Johannesburg | SHIR | Taux d'intérêt au jour le jour en shekel |
| BABs | Obligations Build America Bonds | JSC | Joint Stock Company (Société par actions) | STIBOR | Taux interbancaire offert à Stockholm |
| BBR | Taux sur effets commerciaux de banque | KLIBOR | Taux interbancaire offert à Kuala Lumpur | STRIPS | Négociation distincte des intérêts enregistrés et du principal des titres |
| BBSW | Taux de référence des swaps sur effets commerciaux de banque | KORIBOR | Taux interbancaire offert en Corée | | |
| BRL-CDI | Taux de dépôt interbancaire brésilien (Brazil Interbank Deposit Rate) | LIBOR | Taux interbancaire offert à Londres | TAIBOR | Taux interbancaire offert à Taipei |
| BTP | Buoni del Tesoro Poliennali « obligation du Trésor à long terme » | MIBOR | Taux interbancaire offert à Mumbai | TBA | À annoncer |
| CBO | Obligation garantie (Collateralised Bond Obligation) | MSCI | Morgan Stanley Capital International | À définir | À déterminer |
| CDI | Taux de dépôt interbancaire brésilien (Brazil Interbank Deposit Rate) | NIBOR | Taux interbancaire offert en Norvège | TBD% | Taux d'intérêt à fixer lors du règlement du prêt ou au moment du financement |
| CDO | Obligation garantie (Collateralised Debt Obligation) | OAT | Obligations Assimilables du Trésor | | |
| CHILIBOR | Taux interbancaire offert au Chili | OIS | Overnight Index Swap (Swap sur indice au jour le jour) | TELBOR | Taux interbancaire offert à Tel-Aviv |
| CLO | Prêt garanti (Collateralised Loan Obligation) | PIK | Payment-in-Kind (rémunération en nature) | THB-THORON | Taux de rachat au jour le jour thaïlandais |
| CMBS | Titre adossé à des créances hypothécaires garanti | PRIBOR | Taux interbancaire offert à Prague | TIIE | Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio « Equilibrium Interbank Interest Rate » (Taux d'intérêt d'équilibre interbancaire) |
| | | REIT | Société d'investissement immobilier | | |
| DAC | Designated Activity Company (société à activité désignée) | REMIC | Real Estate Mortgage Investment Conduit | WIBOR | Taux interbancaire offert à Varsovie |
| EURIBOR | Taux interbancaire offert en Euro | | | | |

GESTIONNAIRE

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,
Third Floor,
Harcourt Building,
Harcourt Street,
Dublin,
D02 F721,
Irlande.

CONSEILLERS EN INVESTISSEMENT

Pacific Investment Management
Company LLC,
650 Newport Center Drive,
Newport Beach, California 92660,
États-Unis.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
Londres W1U 3AH,
Royaume-Uni.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapour 018960.

PIMCO Europe GmbH,
Seidlstrasse 24-24a,
80335 Munich,
Allemagne.

AGENT ADMINISTRATIF

State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irlande.

DÉPOSITAIRE

State Street Custodial Services (Ireland)
Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irlande.

DISTRIBUTEURS

PIMCO Europe GmbH,
Seidlstrasse 24-24a,
80335 Munich,
Allemagne.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
Londres W1U 3AH,
Royaume-Uni.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapour 018960.

PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street, Central,
Hong Kong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,
Level 19, 5 Martin Place,
363 George Street,
Sydney, New South Wales 2000,
Australie.

AGENT PAYEUR EN AUTRICHE

UniCredit Bank Austria AG,
Schottengasse 6-8,
1010 Wien,
Autriche.

REPRÉSENTANT À SINGAPOUR

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapour 018960.

BANQUES CORRESPONDANTES EN ITALIE

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,
Piazza Velasca, 7/9,
20122 Milan,
Italie.

State Street Bank International GmbH
– Succursale Italia,
Via Ferrante Aporti, 10,
Milan,
Italie.

Société Générale Securities Services
S.p.A. (« SGSS »),
Via Santa Chiara, 19,
Turin,
Italie.

AllFunds Bank S.A.U.,
Succursale di Milano,
Via Bocchetto, 6,
20123 Milan,
Italie.

Banca Sella Holding S.p.A.,
Piazza Gaudenzio Sella, 1,
13900 Biella,
Italie.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,
Via Verii, 14,
Mantova,
Italie.

RBC Investor Services Bank S.A., succursale
de Milan,
Via Vittor Pisani, 26,
20124 Milan,
Italie.

CACEIS Bank, succursale italienne,
Piazza Cavour 2,
20121 Milan,
Italie.

REPRÉSENTANT À HONG KONG

PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street,
Hong Kong.

AGENT PAYEUR ET REPRÉSENTANT AU LUXEMBOURG

Société Générale Luxembourg,
(Centre opérationnel / FED),
28-32, Place de la Gare,
L-1616, Luxembourg.

AGENT PAYEUR ET REPRÉSENTANT EN SUISSE

BNP PARIBAS Paris,
Succursale de Zurich,
Selnaustrasse 16,
8002 Zurich,
Suisse.

REPRÉSENTANT AU ROYAUME-UNI

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
Londres W1U 3AH,
Royaume-Uni.

AGENT PAYEUR EN BELGIQUE

ABN AMRO BANK S.A.,
Borsbeeksebrug 30,
2600 Anvers,
Belgique.

AGENT PAYEUR ET D'INFORMATION EN ALLEMAGNE

Marcard, Stein & Co AG,
Ballindamm 36,
20095 Hambourg,
Allemagne.

AGENT PAYEUR AU PORTUGAL

Banco Activobank (Portugal) S.A.,
Rua Augusta 86,
1149-023, Lisbonne,
Portugal.

AGENT PAYEUR EN SUÈDE

SEB Merchant Banking,
SE-106 40,
Stockholm,
Suède.

AGENT PAYEUR EN GRÈCE

Eurobank Asset Management M.F.M.C.,
10 Stadiou Street,
GR 10564 Athènes,
Grèce.

AGENT PAYEUR EN HONGRIE

European Investment Centre,
Tomasikova 64,
831 04 Bratislava,
République slovaque.

AGENT PAYEUR EN RÉPUBLIQUE TCHÈQUE

European Investment Centre,
Veveří 2581/102,
616 00 Brno,
République tchèque.

AGENT FINANCIER ET DE CENTRALISATION EN FRANCE

Société Générale,
29, Boulevard Haussmann,
75009 Paris,
France.

AGENT PAYEUR AU LIECHTENSTEIN

LGT Bank Ltd.,
Herrngasse 12,
FL-9490 Vaduz,
Liechtenstein.

AGENT PAYEUR À CHYPRE

EUROBANK CYPRUS LTD.,
28, Spyrou Kyprianou Avenue,
1075 Nicosie,
Chypre.

CONSEILLERS JURIDIQUES EN DROIT IRLANDAIS

Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irlande.

CONSEILLERS JURIDIQUES EN MATIÈRE DE DROIT AMÉRICAIN

Dechert LLP,
1900 K Street N.W.,
Washington, D.C. 20006,
États-Unis.

COMMISSAIRES AUX COMPTES INDÉPENDANTS

PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants and Statutory
Audit Firm,
One Spencer Dock,
North Wall Quay,
Dublin 1,
D01 X9R7,
Irlande.

SECRÉTAIRE

Walkers Corporate Services (Ireland) Limited,
The Exchange,
George's Dock,
Dublin D01 P2V6,
Irlande.

COURTIER PROMOTEUR

Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irlande.

SIÈGE SOCIAL

PIMCO Funds: Global Investors
Series plc,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irlande.

ADMINISTRATEURS DE LA SOCIÉTÉ ET GESTIONNAIRE

V. Mangala Ananthanarayanan¹ (Inde)
Ryan P. Blute¹ (États-Unis)
Craig A. Dawson¹ (États-Unis)
David M. Kennedy (Administrateur
indépendant) (Irlande)
Frances Ruane (Administratrice
indépendante) (Irlande)

Le Prospectus, les Suppléments au Prospectus, l'Acte constitutif et les Statuts de la Société, ainsi que les Documents d'information clé et les rapports annuels et semestriels sont disponibles gratuitement auprès du représentant ou de l'agent de chaque juridiction.

Les actionnaires peuvent obtenir gratuitement une copie des changements apportés au portefeuille au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2023 auprès du Dépositaire ou des Agents payeurs, de l'Agent payeur et d'information en Allemagne et du Représentant suisse.

¹ Salarié de PIMCO.

PIMCO Europe Ltd (société immatriculée sous le n° 2604517) est autorisée et réglementée par la Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, Londres, E20 1JN) au Royaume-Uni. Les services fournis par PIMCO Europe Ltd ne sont pas accessibles aux investisseurs de détail, qui ne doivent pas se fier à la présente communication, mais contacter leur conseiller financier.

PIMCO Europe GmbH (société immatriculée sous le n° 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 Munich, Allemagne), PIMCO Europe GmbH succursale italienne (société immatriculée sous le n° 10005170963), PIMCO Europe GmbH succursale irlandaise (société immatriculée sous le n° 909462), PIMCO Europe GmbH succursale britannique (société immatriculée sous le n° 2604517) et PIMCO Europe GmbH succursale espagnole (N.I.F. W2765338E) sont autorisées et réglementées par l'autorité de surveillance allemande des services financiers (BaFin) (Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Francfort-sur-le-Main) en Allemagne conformément à la Section 15 de la Loi allemande sur les institutions des valeurs mobilières (WpIG). Les succursales italienne, irlandaise, britannique et espagnole sont en outre supervisées par : (1) succursale italienne : la Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) conformément à l'Article 27 de la Loi financière consolidée italienne ; (2) succursale irlandaise : la Banque centrale d'Irlande conformément au Règlement 43 de l'Union européenne (marchés d'instruments financiers) de 2017, tel qu'amendé ; (3) succursale britannique : la Financial Conduct Authority ; et (4) la succursale espagnole : la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) conformément aux obligations stipulées aux articles 168 et 203 à 224, ainsi qu'aux obligations contenues dans le Titre V, Section I de la Loi sur le marché des valeurs mobilières (LSM) et aux articles 111, 114 et 117 du Décret royal 217/2008, respectivement. Les services fournis par PIMCO Europe GmbH ne sont offerts qu'aux professionnels tels que définis à l'Article 67, alinéa 2 de la Loi allemande relative à la négociation de titres (WpHG). Ils ne sont pas disponibles pour les investisseurs particuliers, auxquels nous recommandons de ne pas se fier à cette communication.

PIMCO (Schweiz) GmbH (société immatriculée en Suisse, société immatriculée sous le n° CH-020.4.038.582-2). Les services fournis par PIMCO (Schweiz) GmbH ne sont pas accessibles aux investisseurs de détail, qui ne doivent pas se fier à la présente communication, mais contacter leur conseiller financier.